

자산운용 보고서

1. 기본정보

1. 개요

가. 투자신탁의 명칭 마이다스 원-달러스왑 종류형 채권투자신탁
 나. 분류 채권형 / 추가형 / 개방형 / 종류형
 다. 운용기간 3개월(2007-05-14 ~ 2007-08-13)
 라. 작성자 마이다스에셋자산

간접투자자산 현황

(단위 : 원, 좌/주)

원-달러스왑채권 (52700)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	10,889,968,657	5,588,738,061	-48.68
부채 총액 (B)	4,346,188	3,655,434	-15.89
순자산총액 (C=A-B)	10,885,622,469	5,585,082,627	-48.69
발행 수익증권 총 좌수 (D)	10,628,487,152	5,407,929,277	-49.12
기준가격 (E=C/D*1000)	1,024.19	1,032.76	0.84

원-달러스왑채권C1 (52701)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	747,264,017	526,228,110	-29.58
부채 총액 (B)	1,513,565	1,102,664	-27.15
순자산총액 (C=A-B)	745,750,452	525,125,446	-29.58
발행 수익증권 총 좌수 (D)	732,171,904	512,367,879	-30.02
기준가격 (E=C/D*1000)	1,018.55	1,024.90	0.62

원-달러스왑채권C3 (52703)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	5,021,100,333	5,058,854,516	0.75
부채 총액 (B)	4,174,065	8,043,534	92.70
순자산총액 (C=A-B)	5,016,926,268	5,050,810,982	0.68
발행 수익증권 총 좌수 (D)	5,000,000,000	5,000,000,000	0.00
기준가격 (E=C/D*1000)	1,003.39	1,010.16	0.67

* 기준가격이란 투자신탁의 순자산총액을 발행된 수익증권 총 좌수로 나눈 가격으로 수익증권의 매입 및 환매시 적용되는 가격임.

2. 운용성과

가. 기간 수익률 (, :%)

원-달러스왑채권 (52700)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
투자신탁	3.75	3.32	3.79	4.38	
비교지수					

비교지수(Bench Mark) = 없음

원-달러스왑채권C1 (52701)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
투자신탁	2.91	2.47	2.94		
비교지수					

비교지수(Bench Mark) = 없음

원-달러스왑채권C3 (52703)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
투자신탁	3.12	2.68			
비교지수					

비교지수(Bench Mark) = 없음

나. 연평균 수익률

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
투자신탁				
비교지수				

비교지수(Bench Mark) = 없음 ※ 해당사항없음(1년 미만)

원-달러스왑채권C1 (52701)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
투자신탁				
비교지수				

비교지수(Bench Mark) = 없음 ※ 해당사항없음(1년 미만)

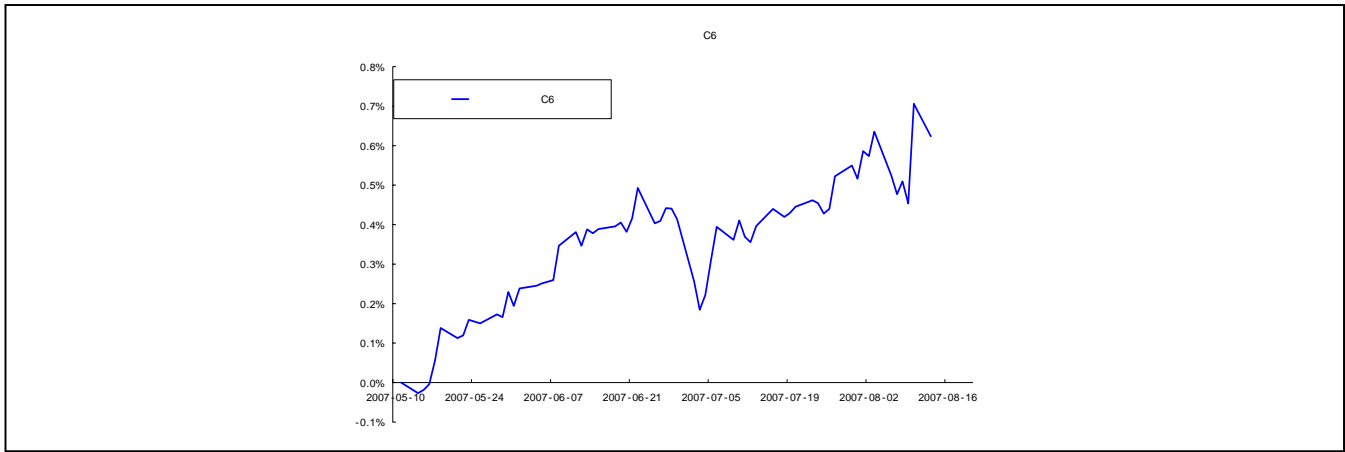
원-달러스왑채권C3 (52703)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
투자신탁				
비교지수				

비교지수(Bench Mark) = 없음 ※ 해당사항없음(1년 미만)

원-달러스왑채권 (52700)



3. 자산구성 현황

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투자증권	특별자산			
원화	0 (0.00)	3,983 (71.27)	0 (0.00)	1 (0.02)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	112 (2.00)	7 (0.12)	4,102 (73.41)
미국달러화	0 (0.00)	1,448 (25.90)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	39 (0.69)	0 (0.00)	1,486 (26.59)

※ ()내는 자산총액에 대한 비중

원-달러스왑채권C1 (52701)

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투자증권	특별자산			
원화	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	526 (100.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	526 (100.00)

※ ()내는 자산총액에 대한 비중

원-달러스왑채권C3 (52703)

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투자증권	특별자산			
원화	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	5,059 (100.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	5,059 (100.00)

※ ()내는 자산총액에 대한 비중

II. 상세정보

1. 투자신탁의 개요

최초설정일	2006-11-14		신탁계약기간종료일	2999-11-14	
자산운용회사	마이다스에셋자산	수탁회사	한국씨티은행	일반사무관리회사	에이브레인(팀스)
판매회사	SK증권	대우증권	교보증권		
투자신탁의 특징	자산의 대부분을 원화 채권과 달러표시 채권에 투자하며, 환율 수준에 따라 국내 채권과 달러표시 채권의 편입비율을 조정하여 채권의 이자수입과 함께 환율변동에 의한 차익을 추구하는 펀드입니다.				

2. 자산보유 및 운용현황

- 주식

(단위 : 주, 원, %)

종목	보유수량	평가금액	비중
해당사항 없음			

※ 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 채권

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 원, %)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안42-12-546-17	4,000,000,000	3,983,016,000	2006-03-17	2007-09-14	무보증(미등록)		73.34
CITNAT 4.625 12/10/07	1,000,000	935,049,508	2002-12-10	2007-12-10			17.22
TREASURY 3.0 11/15/07	450,000	419,519,875	2002-11-15	2007-11-15			7.73
TREASURY 4.375 01/31/08	100,000	92,973,418	2006-01-31	2008-01-31			1.71
합계	4,001,550,000	5,430,558,801					100.00

※ 채권 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 어음 및 채무증서

(단위 : 원, %)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

※ 어음 및 채무증서 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 장내파생상품

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 계약, 원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 계약, 원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
미국달러선물0709	매도	1	46,370,000	
합계		10	463,700,000	0

- 장외파생상품

(단위 : 원)

종류	거래 상대방	기초자산	매수/매도	만기일	계약금액	취득가격	평가금액	비고
해당사항 없음								

- 부동산(임대)

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가격	보증금	비고
	등기번호	취득일	평가금액	임대수입	
			0		
			0		
합계			0		
			0		

원-달러스왑채권C1 (52701)

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가격	보증금	비고
	등기번호	취득일	평가금액	임대수입	
			0		
			0		
합계			0		
			0		

원-달러스왑채권C3 (52703)

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가격	보증금	비고
	등기번호	취득일	평가금액	임대수입	
			0		
			0		
합계			0		
			0		

- 부동산(자금대여 및 차입)

(단위 : 원,%)

종류	대여(차입)기관	계약일자	대여(차입)금액	대여(차입)금리	만기(상환)일	비고
해당사항 없음						

- 실물자산

(단위 : 원)

종류	취득일자	취득가격	평가금액	비고
해당사항 없음				

- 특별자산

원-달러스왑채권C1 (52701)

종류	취득일자	취득가격	평가액	비고
원-달러스왑종류형채		511,602,780	526,228,110	
합계		511,602,780	526,228,110	

원-달러스왑채권C3 (52703)

종류	취득일자	취득가격	평가액	비고
원-달러스왑종류형채		4,995,805,033	5,058,854,516	
합계		4,995,805,033	5,058,854,516	

- 단기대출 및 예금

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 원,%)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 1일물 5.05	교보증권	2007-08-13	100,013,835	5.05	2007-08-14	
예금	한국씨티은행		11,798,747			
외화예금(USD)			38,762,610	4.00		

원-달러스왑채권 (52700)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
합계			150,575,192			

- 기타

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
기타미수금	6,647,070	
합계	6,647,070	

- 유가증권 대여 및 차입

(단위 : 원,%)

종목	대여(차입)기관	대여(차입)수량	대여(차입)수수료	대여(차입)일자	만기(상환)일	비고
해당사항 없음						

3. 매매주식총수, 매매금액 및 매매회전율

매수		매도		비고
수량	금액	수량	금액	
해당사항 없음				

※ 매매회전율이란 주식매매의 빈번한 정도를 나타내는 지표로서 해당 운용기간동안 매도한 주식이금액을 같은 기간동안 평균적으로 보유한 주식이금액으로 나누어 산출. 해당 운용기간동안 평균적인 주식투자 규모가 100억원이고, 주식 매도금액 또한 100억원인 경우 매매회전율은 100%(일회전)임.

4. 운용의 개요 및 손익현황

- 운용개요

동기간 금리는 한국은행의 긴축적 통화운용에 따른 콜금리 2차례 인상과 강한 경기회복세가 이어지면서 국고 3년물 기준 26bp 상승했습니다. 美 서브프라임 모기지 문제가 발생하면서 우량자산 선호현상으로 미국채 가격이 급등하면서 국내 채권가격도 급등하기도 하였으나 서브프라임 모기지 사태가 일단락 되는 모습을 보이면서 다시 가격은 하락세로 돌아섰습니다. 원달러 환율은 글로벌 달러화 약세로 한때 913원까지 하락하며 연중 최저치를 기록하기도 하였으나 미 서브프라임 모기지 사태와 엔캐리 트레이드 청산이 맞물리면서 950원 이상으로 치솟은 후 940원 수준에서 횡보하는 모습을 보였습니다. 동기간 은행채를 국채로 교체매매하였고 930원-950원 박스권 트레이딩을 하고 있으며, 현재 외화자산비율은 원달러 선을 매도 포지션을 감안하여 약 20% 수준 입니다. 원화 부분은 금리 상승세가 추가로 이어진다고 판단하고 있으며 이에 따라 듀레이션을 0.37년으로 가져가면서 금리상승에 따른 영향을 적게 받는 포트폴리오를 유지중입니다. 금리의 경우 전고점을 상향돌파하여 추가적인 상승세는 불가피해 보이니 연말까지 국채 수급여건이 양호하고 경제 성장세가 소폭 둔화될 것으로 보여 큰 폭의 추가 상승시 듀레이션을 늘릴 계획입니다. 환율은 엔 캐리트레이드 청산여부와 글로벌 달러약세의 진행정도에 따라 큰 폭의 변화가 예상됩니다. 원달러 선물을 활용하여 적극적으로 대처하도록 하겠습니다.

- 손익현황

원-달러스왑채권C3 (52703)

(단위 : 백만원,%)

구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투자 증권	특별 자산			
당기손익	0	0	0	0	0	0	0	42	0	0	-8	34
전기손익	0	0	0	0	0	0	0	21	0	0	-4	17

- 보수 지급 현황

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
자산운용회사 보수	0	0.00	0	0.00	
판매회사 보수	0	0.00	0	0.00	
수탁회사 보수	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사 보수	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	0	0.00	0	0.00	

원-달러스왑채권C1 (52701)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
자산운용회사 보수	0	0.05	0	0.06	
판매회사 보수	1	0.13	1	0.14	
수탁회사 보수	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사 보수	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	2	0.20	1	0.21	

원-달러스왑채권C3 (52703)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
자산운용회사 보수	1	0.03	3	0.06	
판매회사 보수	2	0.05	4	0.09	
수탁회사 보수	0	0.01	1	0.01	
일반사무관리회사 보수	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	4	0.08	8	0.16	

※ 투자신탁의 순자산총액 대비 비율

- 총보수, 비용비율

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : %)

구분	전기	당기
총보수, 비용비율	0.11	1.18
매매수수료비율	0.02	0.39

원-달러스왑채권C1 (52701)

(단위 : %)

구분	전기	당기
총보수, 비용비율	0.84	0.84
매매수수료비율	0.00	0.00

원-달러스왑채권C3 (52703)

(단위 : %)

구분	전기	당기
총보수, 비용비율	0.64	0.64
매매수수료비율	0.00	0.00

※ 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 투자신탁에서 부담하는 '보수'와 투자신탁재산의 운용과정에서 경상적·반복적으로 발생하는 유가증권 매매수수료 등의 '기타비용'을 순자산총액으로 나눈 비율로서 해당 운용기간중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냄.

5. 운용전문인력 현황

(단위 : 억원, 개)

성명	연령	직위	운용현황		주요 운용경력 및 이력	협회등록번호
			운용중인 다른 간접투자기구 수	다른 운용 자산 규모		
박정환	1964년	운용역	34	2,279	서울대 경영대석사, 현대투신/한국투신	03-02002-0026
정호균	1973년	운용역	34	2,279	KAIST Techno MBA, SK투신/PCA투신	06-02002-0035
유선아	1972년	운용역	34	2,279	경희대 화학과, 대신투신	01-02002-0018

6. 중개회사별 거래금액/수수료 및 그 비중

주식거래

(단위 : 원,%)

구분	거래금액(비중)		수수료		거래금액(비중)		수수료	
	금액(비중)	수수료율	금액(비중)	수수료율	금액(비중)	수수료율	금액(비중)	수수료율

주식 외 투자증권 거래

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 백만원,%)

구분	6			7			8		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	5,046 (96.44)	0 (0.00)	0.00
	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	396 (100.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
	4,006 (44.78)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
	1,001 (11.19)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
KIDB	3,939 (44.03)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
RBC	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	186 (3.56)	0 (0.00)	0.00

장내파생상품 거래

원-달러스왑채권 (52700)

(단위 : 백만원,%)

구분	6			7			8		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	357,606 (98.23)	13 (98.24)	0.00	162,356 (100.00)	6 (100.00)	0.00
()	1,395 (100.00)	0 (100.00)	0.00	6,439 (1.77)	0 (1.76)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00

7. 이해관계인과의 거래에 관한 사항

(단위 : 백만원)

이해관계인		거래의 종류	자산의 종류	거래금액
성명(상호)	관계			
해당사항 없음				

8. 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사 여부 및 그 내용

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)				불행사사유
				찬성	반대	불행사	중립	
해당사항 없음								

9. 분배금 지급내역

분배금 지급일	분배금 지급금액(백만원)	분배후 수탁고(좌수 기준)	기준가격		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
해당사항 없음					

10. 공지사항

간접투자기구의 운용 및 투자등에 관련하여 보다 자세한 사항은 아래의 주소로 문의하거나, 해당 자산운용회사.판매회사의 영업점에 비치되고 홈페이지 (<http://www.midasasset.com>)에 게재되어 있는 영업보고서 및 사업보고서를 이용할수 있습니다.

주소 : 서울 영등포구 여의도동 23-3 마이다스에셋
전화번호 : 02)3787 - 3500