

자산운용 보고서

1. 기본정보

1. 개요

가. 투자신탁의 명칭	마이더스블루칩배당30채권혼합형투자회사
나. 분류	유추열(채권혼합형) / 폐쇄형
다. 운용기간	3개월(2007-07-04 ~ 2007-10-03)
라. 작성자	마이더스에셋자산

간접투자자산 현황

(단위 : 원, 좌/주)

	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	16,769,890,686	18,533,660,423	10.52
부채 총액 (B)	1,109,168,083	96,642,574	-91.29
순자산총액 (C=A-B)	15,660,722,603	18,437,017,849	17.73
발행 수익증권 총 수 (D)	14,369,399,246	16,300,210,478	13.44
기준가격 (E=C/D*1000)	1,089.87	1,131.09	3.78

※ 기준가격이란 투자신탁의 순자산총액을 발행된 수익증권 총 수로 나눈 가격으로 수익증권의 매입 및 환매시 적용되는 가격임.

2. 운용성과

가. 기간 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
투자신탁	2.18	3.78	12.33	13.11	15.33
비교지수	2.37	4.22	12.58	15.07	16.69

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 30% + 블룸버그(국고채1~2년물) 70%

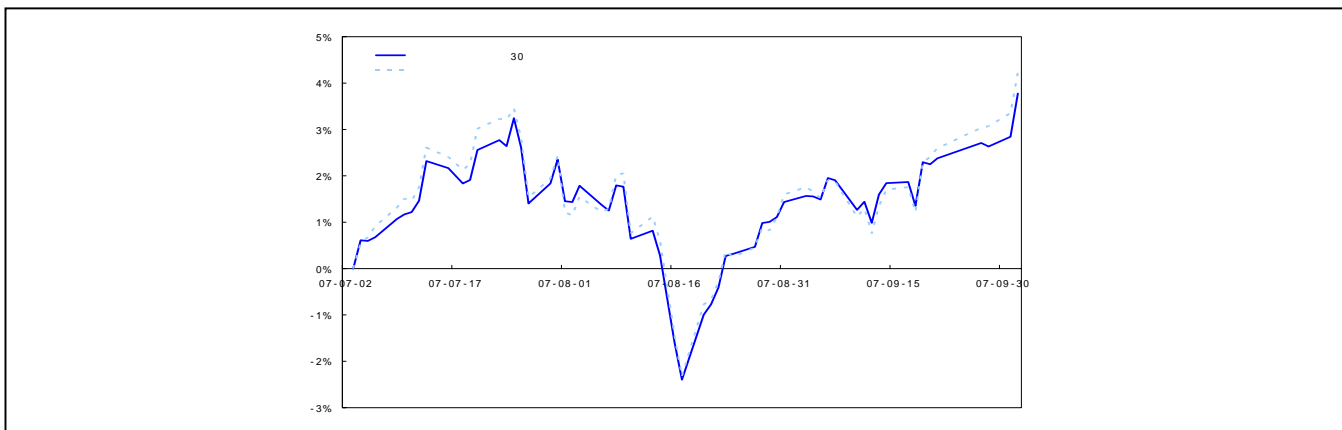
나. 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
투자신탁	15.33	10.57	12.97	10.58
비교지수	16.69	13.61	7.28	7.66

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 30% + 블룸버그(국고채1~2년물) 70%

벤치마크 : KOSPI 30% + 블룸버그(국고채1~2년물) 70%



3. 자산구성 현황

(단위 : 백만원,%)

동화별 구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총 액
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투 자증권	특별 자산			
원화	5,213 (28.13)	10,615 (57.28)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2,702 (14.58)	14 (0.07)	18,544 (100.06)
합계	5,213 (28.13)	10,615 (57.28)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2,702 (14.58)	14 (0.07)	18,544 (100.00)

※ ()내는 자산총액에 대한 비중

II. 상세정보

1. 투자신탁의 개요

설립일	2002-01-04	등록일	2002-01-17		2008-01-03
자산운용회사 (법인이사)	마이다스에셋자산		감독이사	김진배	이용모
자산보관회사	국민은행		일반사무관리회사	에이브레인(팀스)	
판매회사	하나대투증권 교보증권	(주)신한은행	한국외환은행	현대증권	마이다스자산운용
	(단위 : 원, 좌/주)				
투자회사의 특징	회사는 채권에 자산총액의 40%이상, 주식은 자산총액의 30%이내로 투자하고, 선물 및 옵션에 일부 투자하므로 성장주식형펀드에 비하여 상대적으로 낮은 위험과 안정적인 수익을 추구하는 투자자에게 적합합니다.				

2. 자산보유 및 운용현황

- 주식

(단위 : 주, 원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	700	405,300,000	7.77
POSCO	444	339,660,000	6.52
GS건설	1,360	238,680,000	4.58
국민은행	2,815	229,704,000	4.41
현대중공업	435	189,007,500	3.63
신한지주	2,947	187,429,200	3.60
한화	2,018	152,762,600	2.93
LG화학	1,456	148,512,000	2.85
STX조선	2,579	146,229,300	2.81
금호산업	2,238	139,427,400	2.67
대한항공	2,005	132,530,500	2.54
한진중공업	1,517	130,462,000	2.50
SK에너지	812	129,108,000	2.48
삼성화재	619	125,657,000	2.41
현대제철	1,479	121,425,900	2.33
대한전선	2,300	119,370,000	2.29
LG전자	1,300	110,630,000	2.12
한진해운	2,090	100,424,500	1.93
한국전력	2,280	98,724,000	1.89
제일모직	1,575	98,437,500	1.89

(단위 : 주,원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
KCC	172	96,492,000	1.85
SK	472	94,636,000	1.82
한국가스공사	1,597	92,626,000	1.78
동부화재	2,330	92,268,000	1.77
현대차2우B	2,490	91,009,500	1.75
KT	1,950	90,675,000	1.74
외환은행	5,940	88,209,000	1.69
강원랜드	3,170	84,956,000	1.63
동국제강	1,350	76,275,000	1.46
SK텔레콤	343	74,259,500	1.42
LG	1,080	73,440,000	1.41
대신증권우	4,240	73,140,000	1.40
우리투자증권우	4,760	72,114,000	1.38
LG상사	2,440	69,784,000	1.34
KT&G	849	61,977,000	1.19
한솔제지	2,850	57,285,000	1.10
녹십자	623	57,129,100	1.10
NH투자증권	3,300	54,450,000	1.04
CJ제일제당	222	54,390,000	1.04
동아제약	521	51,787,400	0.99
유진기업	4,214	47,196,800	0.91
대우차판매	1,020	46,206,000	0.89
웅진홀딩스	2,440	45,018,000	0.86
SK케미칼	506	44,224,400	0.85
호텔신라	1,500	43,350,000	0.83
현진소재	897	42,697,200	0.82
한미반도체	3,010	35,969,500	0.69
동부건설우	2,500	31,750,000	0.61
CJ	378	26,233,200	0.50
합계	90,133	5,213,029,000	100.00

※ 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 채권

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안42-715-2-12	4,500,000,000	4,540,225,500	2006-04-12	2008-04-12	무보증(미등록)		42.77
국고0475-1203	4,000,000,000	3,889,472,000	2007-03-10	2012-03-10	무보증(미등록)		36.64
통안42-737-2-30	1,700,000,000	1,698,478,500	2006-08-30	2008-08-30	무보증(미등록)		16.00
통안43-47-364-4	500,000,000	487,116,500	2007-04-04	2008-04-02	무보증(미등록)		4.59
합계	10,700,000,000	10,615,292,500					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

(단위 : 계약,원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 C 200710 255.0	매도	14	7,210,000	

- 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

(단위 : 주,원,%)

매수		매도		3개월 매매회전율
수량	금액	수량	금액	
22,474	1,055,736,600	32,770	1,088,939,420	23.78

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

4. 운용의 개요 및 손익현황

- 운용개요

동 기간 중 국내 주식시장은 종합주가지수 기준으로 11.55% 상승하는 흐름을 보였습니다. 글로벌 증시의 동반 상승에 힘입어 한국증시 역시 미국, 유럽, 중국 등 주요국 증시 신고가경신에 대해 동조화되었습니다. 그러나 미국의 서브프라임 위기에서 촉발된 신용경색으로 주식시장은 7월말부터 8월 중순까지 한차례 큰폭의 조정을 보이기도 하였습니다. 이후 미국의 금리인하로 글로벌 주식시장이 안정을 되찾기 시작하였고 개인 및 기관들의 순매수에 힘입어 종합주가지수는 재차 연중 최고치를 경신하였습니다. 보고서일 현재 포트폴리오는 삼성전자, POSCO, 한국전력, SK텔레콤, GS건설, 국민은행, 신한지주, 현대중공업, KT&G, SK, LG전자, 한진해운 등의 블루칩 종목과 대신증권우, 대한전선, 동국제강, 웅진홀딩스, 한미반도체 등 중소형 고배당주 종목으로 구성되어 있습니다. 기간 중 블루칩 포트폴리오 중에서는 GS건설, POSCO, 현대제철, 대한항공, 제일모직 등이 양호한 수익률을 보였으며, 삼성전자, 국민은행, 현대차2우B, KT, 한국가스공사 등의 수익률이 부진하였습니다. 고배당주 포트폴리오중에서는 대한전선, 동국제강, 호텔신라, 동부건설우 등이 양호한 수익률을 보였으며, 유진기업, 한미반도체, LG상사, NH투자증권 등의 수익률이 부진하였습니다. 당 펀드는 추가하락위험을 일정부분 헤지하고 추가 수익을 얻고자 현물주식을 보유하면서 콜옵션을 매도하는 커버드콜 전략을 보조적으로 사용하고 있습니다. 커버드콜 전략은 주식시장이 단기적으로 급등시 펀드 수익률 상승이 일부 제한될 수 있으나, 주식시장이 횡보하거나 완만히 움직일 경우에는 추가적인 수익을 얻을 수 있는 유효한 전략입니다.

- 손익현황

(단위 : 백만원,%)

구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투 자증권	특별 자산			
당기손익	682	19	0	-15	0	0	0	0	0	18	-67	638
전기손익	1,471	-10	0	-25	0	0	0	0	0	19	-71	1,384

- 보수 지급 현황

(단위 : 백만원)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
자산운용회사 보수	20	0.11	19	0.12	
판매회사 보수	45	0.26	42	0.26	
수탁회사 보수	1	0.01	1	0.01	
일반사무관리회사 보수	2	0.01	2	0.01	
보수 합계	68	0.39	64	0.39	

※ 투자신탁의 순자산총액 대비 비율

- 총보수·비용비율

(단위 : %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	1.77	1.70
매매수수료비율	0.12	0.06

※ 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 운용자산 규모		
허필석	1967년	운용역	13	9,531	KAIST Techno MBA, 장기신용/삼성증권	00-02002-0011
계상현	1974년	운용역	15	2,879	서강대 경영학, KTB	05-02002-0029
이승준	1973년	운용역	5	2,799	Columbia Univ. Financial Math, 신영증권/미래에셋자산운용	06-02002-0034
박정환	1964년	운용역	38	2,304	서울대 경영대석사, 현대투신/한국투신	03-02002-0026
정호균	1973년	운용역			KAIST Techno MBA, SK투신/PCA투신	06-02002-0035
유선아	1972년	운용역			경희대 화학과, 대신투신	01-02002-0018

6. 중개회사별 거래금액/수수료 및 그 비중

주식거래

(단위 : 백만원.%)

구분	8			9			10		
	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	28 (4.13)	0 (3.52)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	78 (11.50)	0 (9.83)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
	275 (50.48)	0 (5.20)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
ABN AMRO ()	216 (39.75)	0 (84.43)	0.00	117 (17.23)	0 (29.42)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
NH ()	53 (9.77)	0 (10.37)	0.00	456 (67.13)	0 (57.23)	0.00	922 (100.00)	1 (100.00)	0.00

주식 외 투자증권 거래

(단위 : 백만원.%)

구분	8			9			10		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율
	3,476 (7.86)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00
	33,277 (75.26)	0 (0.00)	0.00	31,822 (63.50)	0 (0.00)	0.00	12,326 (48.56)	0 (0.00)	0.00
	3,498 (7.91)	0 (0.00)	0.00	18,290 (36.50)	0 (0.00)	0.00	13,057 (51.44)	0 (0.00)	0.00
	3,964 (8.97)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00

장내파생상품 거래

(단위 : 백만원.%)

구분	8			9			10		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율
IB	25 (100.00)	0 (100.00)	0.00	10 (100.00)	0 (100.00)	0.00	22 (100.00)	0 (100.00)	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	
CJ우	070726	1,190	제1호의안: 분할계획서 승인의 건	1,190	0	0	0	
한국가스공사	070810	1,809	제1호의안 : 비상임이사 선임의 건	1,809	0	0	0	
NH투자증권	070823	3,070	제1호의안 : 정관변경의 건	3,070	0	0	0	
NH투자증권	070823	3,070	제2호의안 : 사외이사가 아닌 감사위원 선임의 건	3,070	0	0	0	
NH투자증권	070823	3,070	제3호의안 : 사외이사인 감사위원 선임의 건	3,070	0	0	0	
한국전력	070830	2,560	제1호의안 : 상임이사 선임의 건	2,560	0	0	0	
한국전력	070830	2,560	제2호의안 : 정관 변경의 건	2,560	0	0	0	
LG화학	070914	1,302	제1호의안 : 합병계약 승인의 건	1,302	0	0	0	

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