자산운용 보고서

Ⅰ 기본정보

1. 개요

가 투자회사의 명칭 : 마이다스절대수익안정형투자회사

나 분류 : 혼합채권형(MF) (추가형/개방형)

다 운용기간 : 3개월 (2007년06월16일 ~ 2007년09월15일)

라 작성자 : 마이다스에셋자산운용(주)

간접투자재산 현황

(단위 : 원, 좌/주)

	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	9,180,194,552	9,075,191,382	-1.14%
부채 총액 (B)	209,847,394	53,308,470	-74.60%
순자산총액(C=A-B)	8,970,347,158	9,021,882,912	0.57%
발행 수익증권 총수 (D)	8,456,102,989	8,541,254,120	1.01%
기준가격 (E = C / D x 1000)	1,060.81	1,056.27	-0.43%

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

2. 운용성과

가 기간수익률

(단위: %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
투자신탁	-0.70	-0.43	3.59	3.99	5.63

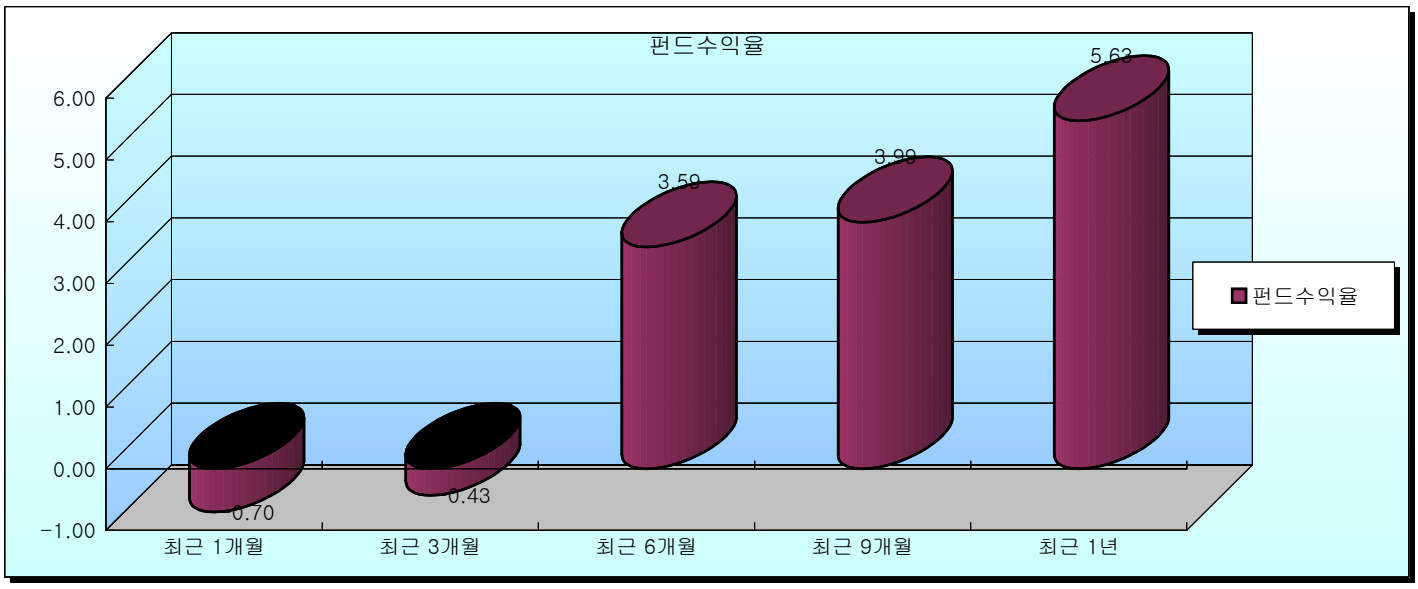
*비교지수(Bench Mark) 없음

나 연평균수익률

(단위: %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
투자신탁	5.63	8.07	6.89	0.00

*비교지수(Bench Mark) 없음



3. 자산구성 현황

(단위:백만원,%)

통화별 구분	투자증권			파생상품		부동산	실물자산	특별자산		단기 대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투자증권	기타			
KRW	2,313	6,022	0	125	0	0	0	0	0	612	4	9,075
비중	25.48	66.36	0.00	1.37	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	6.75	0.04	100.00

* ( )내는 자산총액에 대한 비중

II 상세정보

1. 투자회사의 개요

설립일	2003-09-16	등록일	2003-09-15	존립기간만료일	
자산운용회사 (법인이사)	마이다스에셋자산운용(주)		감독이사	라동민 ,박진국	
자산보관회사	하나은행㈜		일반사무관리회사	외환펀드서비스㈜	
판매회사	대우증권㈜, 한국투자증권㈜. 굿모닝신한증권㈜, 현대증권㈜, 동부증권㈜, 대한투자증권㈜, ㈜신한은행, ㈜한국씨티은행, 교보증권㈜				
투자회사의 특징	안정형펀드로서 투자목적을 달성하기 위하여 순자산총액의 70%이상을 채권 및 유동성자산에 투자하고 주식에 대한 투자는 순자산총액의 30% 이내로 한정합니다. 특히 4가지의 투자전략(포트폴리오 헤지전략, 선물시스템트레이딩, 옵션합성전략, Event Arbitrage)를 복합적으로 사용하여 주가변동방향에 관계없이 안정적인 수익률을 달성하는 것을 목표로 합니다.채권은 국공채, 주식관련사채, 신용등급 A-이상인 사채권, 기타 이자지급 유가증권에 주로 투자하며 기업어음(CP)은 신용등급A3(0)이상인 경우에 투자합니다.				

2. 자산보유 및 운용현황

◆ 주식

(단위: 주,백만원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중*
삼성전자	400	222	2.45
현대중공업	300	114	1.26
LG화학	1,050	102	1.12
POSCO	150	92	1.01
LG필립스LCD	2,000	84	0.93
국민은행	1,050	76	0.84
동부화재	1,800	70	0.77
삼성물산	1,000	67	0.74
삼성화재	350	65	0.71
현대건설	700	62	0.69
한국가스공사	1,000	61	0.68
현대제철	770	61	0.67
NHN	300	60	0.66
외환은행	4,000	59	0.65
부광약품	2,000	58	0.64
SK에너지	355	56	0.62
제일모직	1,000	56	0.61
KCC	100	54	0.59
신한지주	1,000	54	0.59
우리금융	2,500	52	0.57
휴니드	4,000	50	0.55
현대차	706	49	0.54

대한항공	800	48	0.53
한화	700	46	0.51
현대모비스	500	46	0.51
LG전자	588	46	0.51
대우건설	1,800	46	0.50
하이닉스	1,500	46	0.50
한진해운	1,000	44	0.49
하나투어	527	44	0.48
두산인프라코어	1,300	43	0.47
롯데쇼핑	100	39	0.43
텔레칩스	2,007	33	0.36
LG상사	1,000	30	0.33
LG	500	28	0.31
STX조선	500	28	0.31
유한양행	150	28	0.31
SK	145	26	0.29
교보증권	1,000	22	0.24
동아제약	200	21	0.23
유니텍전자	7,497	18	0.20
텔레칩스무상(보)	401	7	0.07
합계	48,746	2,313	25.48

* 비중은 전체자산 중 해당 종목이 차지하는 비중

◆ 채권 (단위:백만원,%)

종목	액면가액	평가액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안41-739-2-12	2,000	2,016	2005-10-12	2007-10-12		N/A	22.22
국고채권0475-1203	2,000	1,950	2007-03-10	2012-03-10		N/A	21.48
통안42-715-2-12	1,500	1,509	2006-04-12	2008-04-12		N/A	16.63
통안43-707-2-28	500	498	2007-02-28	2009-02-28		N/A	5.48
통안42-24-546-14	50	49	2006-07-14	2008-01-11		N/A	0.54
합계	6,050	6,022					66.36

* 비중은 전체자산 중 당해채권이 차지하는 비율 기재

◆ 어음 및 채무증서 (단위:백만원,%)

종목	액면가액	평가액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당없음							

* 비중은 전체자산 중 해당 종목이 차지하는 비중

◆ 장내파생상품 (단위: 계약,백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
KOSPI200선물0712	매도	18	2,142	0
HFG IB증권	위탁증거금	0	0	125
합계		18	2,142	125

◆ 장외파생상품 (단위: 계약,백만원)

종류	거래상대방	기초자산	매수/매도	만기일	계약금액	취득가격 (예금액)	평가금액	비 고
해당없음								

◆ 부동산(임대) (단위:백만원)

종류	소재지		취득가격	평가금액	보증금	임대수입	비 고
	등기번호	취득일					

해당없음

◆ 부동산(자금대여 및 차입) (단위:백만원,%)

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

◆ 실물자산 (단위:백만원)

종류	취득일자	취득가격	평가금액	비고
해당없음				

◆ 특별자산 (단위:백만원,%)

종류	취득일자	취득가격	평가금액	비고
해당없음				

◆ 단기대출 및 예금 (단위:백만원,%)

종류	금융기관	단기대출 (예금)일자	단기대출 (예금)금액	적용금리	만기일	비고
콜론	대신증권	2007-09-14	600	5.03	2007-09-17	
은대	하나은행(통합)		12	0.10		
합계			612			

◆ 기타 (단위:백만원)

종류	평가금액	비고
선납원천세	4	
합계	4	

◆ 유가증권대여 및 차입 (단위:주,원,%)

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

3. 매매주식총수, 매매금액 및 매매회전율 (단위:백만원,%)

매수		매도		3개월 매매회전율
수량	금액	수량	금액	
95,627	1,635	107,890	1,723	74.5775

* 매매회전율 = 당해 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 당해 운용기간동안 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

4. 운용의 개요 및 손익현황

◆ 운용개요

지난 분기중 펀드의 주식 포트폴리오에서는 대형주중에서는 삼성물산, CJ인터넷, 대한항공, 하이닉스, 풍산, 중소형주 중에서는 덕산하이메탈, 호텔신라, 현대DSF, 대우정밀 등의 편입을 확대하였습니다. 보유주식포트폴리오가 지수보다 좋은 실적을 올리면서 펀드 수익에 기여하였습니다. 한편 글로비스, EMW안테나, 모젬, 디오스텍, 유진테크, 모건코리아 등 공모주에도 투자하여 좋은 투자실적을 거두었습니다.

◆ 손익현황 (단위 : 백만원)

구 분	투자증권			파생상품		부동산	실물자산	특별자산		단기 대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투 자증권	기타			
당기손익	187	18	0	-225	0	0	0	0	0	7	-26	-39
전기손익	732	1	0	-354	0	0	0	0	0	11	-26	363

◆ 보수지급 현황 (단위: 백만원)

구분	전기		당기		비 고
	금액	비율	금액	비율	
자산운용회사 보수	10	0.12	10	0.11	
판매회사 보수	13	0.14	12	0.14	
수탁회사 보수	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사 보수	1	0.01	1	0.01	
보수 합계	25	0.28	24	0.27	

* 투자신탁의 순자산총액 대비 비율

◆ 총보수,비용비율 (단위 : %)

구분		전기	당기
총보수.비용비율		1.7024	1.6006
	매매수수료비율	0.5611	0.4438

총보수,비용비율(TER : Total Expense Ratio) :

운용보수등 투자신탁에서 부담하는 보수와 투자신탁재산의 운용과정에서 경상적,반복적으로 발생되는 유가증권 매매수수료등의 기타비용을 순자산총액으로 나눈 비율로서 해당 운용기간중 투자자가 부담한 총 보수,비용수준을 나타냄

5. 운용전문인력현황 (단위 : 억원,개)

성명	연령	직위	운용현황		주요 운용경력 및 이력	협회등록번호
			운용중인 다른 간접투자기구 수	다른 운용자산 규모		
허필석	67년생		11	9,136	KAIST 테크노 MBA 장기신용은행 자금증권부, 금융공학팀 삼성증권 자금부 CFA 現) 마이다스에셋 파생상품 운용팀장	00-02002-0011

* 책임운용전문인력이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함

6. 중개회사별 거래금액 수수료 및 그 비중

◆ 주식 거래 (단위: 백만원,%)

구분	07-06-16 ~ 07-07-15			07-07-16 ~ 07-08-15			07-08-16 ~ 07-09-15		
	거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료	
		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율
SK증권	224 (47.45)	0 (41.4)	0.10%	529 (28.94)	1 (28.94)	0.10%	239 (22.55)	0 (22.55)	0.10%
한국투자증권	129 (27.38)	0 (23.89)	0.10%	161 (8.8)	0 (8.8)	0.10%	237 (22.4)	0 (22.4)	0.10%
미래에셋증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	0 (0)	0 (0)	0.00%	226 (21.36)	0 (21.36)	0.10%
푸르덴셜투자증권	50 (10.54)	0 (9.2)	0.10%	163 (8.89)	0 (8.89)	0.10%	159 (15.07)	0 (15.07)	0.10%
CJ투자증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	357 (19.5)	0 (19.5)	0.10%	118 (11.13)	0 (11.13)	0.10%
동부증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	0 (0)	0 (0)	0.00%	75 (7.06)	0 (7.06)	0.10%
HFG IB증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	0 (0)	0 (0)	0.00%	4 (0.4)	0 (0.39)	0.10%

대우증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	63 (3.42)	0 (3.42)	0.10%	0 (0)	0 (0)	0.00%
굿모닝신한증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	292 (15.99)	0 (15.99)	0.10%	0 (0)	0 (0)	0.00%
삼성증권	69 (14.6)	0 (25.49)	0.20%	0 (0)	0 (0)	0.00%	0 (0)	0 (0)	0.00%
현대증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	264 (14.41)	0 (14.41)	0.10%	0 (0)	0 (0)	0.00%

* 주식의 총 거래금액 및 총 수수료에 대한 중개회사별 비중

◆ 주식 외 투자증권 거래 (단위: 백만원,%)

구분	07-06-16 ~ 07-07-15			07-07-16 ~ 07-08-15			07-08-16 ~ 07-09-15		
	거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료	
		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율
서울증권	2,998 (13.48)	0 (0)	0.00%	5,795 (22.11)	0 (0)	0.00%	8,000 (66.72)	0 (0)	0.00%
브릿지증권	19,243 (86.51)	0 (0)	0.00%	16,937 (64.63)	0 (0)	0.00%	3,990 (33.27)	0 (0)	0.00%
한국자금중개	0 (0)	0 (0)	0.00%	1,982 (7.56)	0 (0)	0.00%	0 (0)	0 (0)	0.00%
리딩투자증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	1,490 (5.68)	0 (0)	0.00%	0 (0)	0 (0)	0.00%

* 주식외 투자증권의 총 거래금액 및 총 수수료에 대한 중개회사별 비중

◆ 장내파생상품 거래 (단위: 백만원,%)

구분	07-06-16 ~ 07-07-15			07-07-16 ~ 07-08-15			07-08-16 ~ 07-09-15		
	거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료	
		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율		금액 (비중)	수수료율
HFG IB증권	0 (0)	0 (0)	0.00%	11,702 (71.07)	1 (81.32)	0.01%	36,735 (80.67)	4 (77.31)	0.01%
굿모닝신한증권	163 (100)	0 (100)	0.30%	4,762 (28.92)	0 (18.67)	0.01%	8,799 (19.32)	1 (22.68)	0.01%

* 장내파생상품의 총 거래금액 및 총 수수료에 대한 중개회사별 비중

7. 이해관계인과의 거래에 관한 사항 (단위: 백만원)

이해관계인		거래의 종류*	자산의 종류	거래금액
성명(상호)	관계			
해당없음				

* 매매거래,위탁거래,중개거래,임차거래 등

8. 의결권공시대상법인에 대한 의결권행사여부 및 그 내용(의결권을 행사하지 아니한 경우에는 그 사유)

회사명	주주총회일	보유주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)				불행사의 경우 그 사유
				찬성	반대	불행사	중립	
한국가스공사	2007-08-10	1,000	이사 선임	0	0	1,000	0	
LG화학	2007-09-14	1,050	합병 승인	0	0	1,050	0	

9. 분배금 지급내역

분배금 지급일	(백만원)	(좌수기준)	분배금지급전	분배금지급후	비고
2007-09-17	481	9,021,882,912	1,056.27	1,000.00	

10. 공지사항

* 간접투자기구평가회사가 평가한 정보가 있을 경우 이를 기재할 수 있음(공모간접투자기구에 한함)
* 간접투자기구의 운용 및 투자 등에 관련하여 보다 자세한 사항은 아래의 주소로 문의하거나, 해당 자산운용회사 및 판매회사의 영업점에 비치되고 홈페이지에 기재되어 있는 영업보고서 및 사업보고서를 이용할 수 있습니다.

  주소 : 서울시 영등포구 여의도동 23-3

  전화번호 : 02-3787-3500

  홈페이지 : http://www.midasasset.com