

자산운용 보고서

투자신탁명(투자회사명) 마이다스블루칩배당혼합투자신탁C호
 투자신탁의 종류(형태) 주식혼합형
 운용기간 2006-11-16 ~ 2007-02-15

1. 투자신탁(투자회사)의 개요

최초설정일	2004-11-16	투자신탁기간	822 일
자산운용회사	마이다스에셋자산		
판매회사	한국씨티은행		
수탁회사	하나은행(서울)	일반사무관리회사	에이브레인(팀스)
투자신탁의 특징	주식에 펀드 자산의 50%내외로 투자하며, 주식 투자시 블루칩 배당주에 주로 투자하여 높은 배당수익을 누리면서도 지수상승시의 수익 제고를 추구하는 펀드		

주) 투자신탁기간 : 펀드설정일로부터 보고서 작성 기준일까지의 운용기간

2. 투자신탁(투자회사)의 현황

(단위 : 백만원)

자산총액	237,014	부채총액	20,654	
순자산총액	216,360	기준가격(원)	전기말	1,078.85
			당기말	1,018.13

3. 자산구성 현황 및 비율

(단위 : 백만원,%)

구분	투자증권			단기대출 및 예금	파생상품		부동산	실물 자산	간접투 자증권	특별 자산	기타 자산	자산총액
	주식	채권	기타		장내	장외						
금액	121,599	76,579	0	22,837	-58	0	0	0	0	0	16,057	237,014
비율	51.30	32.31	0.00	9.64	-0.02	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	6.77	100.00

* 자산운용보고서 작성기준일 현재 대차대조표의 관련금액을 기재함

기타 : CD/CP

기타자산 : 미수금, 선급비용, 선납원천세, 이연자산 등

* 파생상품 액면금액 별도표시 - 장내파생 : 134

4. 자산보유 및 운용현황

- 주식

(단위 : 주,원,%)

종 목 명	보유 수량	취득가액	평가액	평가손익	비율
삼성전자	16,495	10,624,526,610	9,468,130,000	-1,156,396,610	3.99
대신증권우	379,390	5,595,369,200	5,577,033,000	-18,336,200	2.35
한진중공업	162,812	4,611,366,100	4,973,906,600	362,540,500	2.10
LG상사	218,480	4,727,987,010	4,872,104,000	144,116,990	2.06
KT	112,418	5,053,189,100	4,867,699,400	-185,489,700	2.05
기업은행	240,000	3,960,000,000	4,728,000,000	768,000,000	1.99
POSCO	13,028	3,576,186,000	4,664,024,000	1,087,838,000	1.97

(단위 : 주,원,%)

종 목 명	보유 수량	취득가액	평가액	평가손익	비율
KT&G	79,387	4,620,323,400	4,556,813,800	-63,509,600	1.92
대한전선	200,000	4,841,859,849	4,380,000,000	-461,859,849	1.85
GS건설	49,000	3,910,754,133	4,272,800,000	362,045,867	1.80
우리금융	160,000	3,328,000,000	4,120,000,000	792,000,000	1.74
SK텔레콤	19,754	4,247,110,000	4,010,062,000	-237,048,000	1.69
한국전력	89,898	3,492,537,300	3,658,848,600	166,311,300	1.54
제일모직	87,770	3,510,800,000	3,510,800,000	0	1.48
CJ우	79,008	4,108,416,000	3,504,004,800	-604,411,200	1.48
LG생활건강우	61,290	2,758,050,000	2,997,081,000	239,031,000	1.26
S-Oil우	57,400	3,128,300,000	2,944,620,000	-183,680,000	1.24
LG전자우	70,740	2,507,733,000	2,394,549,000	-113,184,000	1.01
한국가스공사	63,157	2,501,017,200	2,365,229,650	-135,787,550	1.00
삼성화재	14,000	2,365,363,000	2,296,000,000	-69,363,000	0.97
신한지주	40,000	1,860,000,000	2,252,000,000	392,000,000	0.95
국민은행	25,000	1,941,016,590	2,205,000,000	263,983,410	0.93
금호산업우	278,610	2,696,443,948	2,150,869,200	-545,574,748	0.91
우리투자증권우	152,766	1,940,128,200	1,978,319,700	38,191,500	0.83
STX조선	105,954	1,416,993,330	1,854,195,000	437,201,670	0.78
웅진코웨이	69,309	1,694,692,981	1,784,706,750	90,013,769	0.75
KCC	6,459	1,905,405,000	1,734,241,500	-171,163,500	0.73
KTF	64,079	1,935,185,800	1,701,297,450	-233,888,350	0.72
강원랜드	80,000	1,489,448,300	1,508,000,000	18,551,700	0.64
휴스틸	102,490	1,429,735,500	1,506,603,000	76,867,500	0.64
아모레퍼시픽	2,598	1,322,382,000	1,499,046,000	176,664,000	0.63
외환은행	99,700	1,347,539,180	1,390,815,000	43,275,820	0.59
LG화학	30,000	1,255,098,140	1,381,500,000	126,401,860	0.58
한화	37,670	1,220,508,000	1,369,304,500	148,796,500	0.58
삼성전자우	3,000	1,473,000,000	1,296,000,000	-177,000,000	0.55
현대차2우B	30,000	1,298,647,240	1,225,500,000	-73,147,240	0.52
SK	14,300	1,148,411,860	1,186,900,000	38,488,140	0.50
무림페이퍼	125,570	1,127,576,183	1,035,952,500	-91,623,683	0.44
부산은행	75,359	877,932,350	1,013,578,550	135,646,200	0.43
리바트	80,570	1,031,296,000	999,068,000	-32,228,000	0.42
삼성엔지니어링	20,000	786,953,800	988,000,000	201,046,200	0.42
한미반도체	130,000	982,995,459	847,600,000	-135,395,459	0.36
호텔신라	47,682	748,607,400	705,693,600	-42,913,800	0.30
대구백화점	37,874	681,732,000	645,751,700	-35,980,300	0.27
한미약품	5,000	580,079,500	557,500,000	-22,579,500	0.24
S&T대우	25,000	600,000,000	487,500,000	-112,500,000	0.21
한국주철관	120,000	468,000,000	468,000,000	0	0.20
보령제약	11,010	376,648,480	413,976,000	37,327,520	0.17
한진해운	10,000	338,614,270	339,000,000	385,730	0.14
이건창호	80,000	283,600,000	297,600,000	14,000,000	0.13
지엔코	77,000	278,740,000	294,140,000	15,400,000	0.12
청호컴넷	9,780	182,845,150	181,908,000	-937,150	0.08
에스코	4,470	120,019,500	128,736,000	8,716,500	0.05
보령제약배신	238	1,190,000	8,948,800	7,758,800	0.00
합계	4,175,515	120,310,354,063	121,598,957,100	1,288,603,037	51.30

- 채권

(단위 : 원,%)

종 목 명	액면가액	평가액	이표	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비율
통안42-26-546-18	18,000,000,000	17,154,864,000	4.55	2006-08-18	2008-02-15	무보증(미등록)		7.24
통안41-737-2-28	10,000,000,000	10,058,510,000	4.80	2005-09-28	2007-09-28	무보증(미등록)		4.24
통안41-729-2-27	7,000,000,000	6,990,207,000	4.08	2005-07-27	2007-07-27	무보증(미등록)		2.95
통안42-139-182-24	7,000,000,000	6,910,197,000	4.54	2006-11-24	2007-05-25	무보증(미등록)		2.92
통안43-1-364-3	6,500,000,000	6,230,172,000	4.75	2007-01-03	2008-01-02	무보증(미등록)		2.63
통안42-737-2-30	6,000,000,000	6,048,954,000	4.79	2006-08-30	2008-08-30	무보증(미등록)		2.55
통안42-729-2-12	5,000,000,000	5,024,555,000	4.95	2006-07-12	2008-07-12	무보증(미등록)		2.12
통안42-743-2-18	5,000,000,000	4,994,630,000	4.64	2006-10-18	2008-10-18	무보증(미등록)		2.11
통안43-15-364-8	5,000,000,000	4,770,160,000	4.79	2007-02-08	2008-02-07	무보증(미등록)		2.01
국민주택1종06-10	5,000,000,000	4,605,625,000	3.00	2006-10-31	2011-10-31	무보증(미등록)		1.94
통안42-745-2-31	3,000,000,000	2,997,072,000	4.75	2006-10-31	2008-10-31	무보증(미등록)		1.26
통안41-30-546-14	800,000,000	794,171,200	4.41	2005-10-14	2007-04-13	무보증(미등록)		0.34
합계	78,300,000,000	76,579,117,200						32.31

- 어음

(단위 : 원,%)

종 목 명	액면가액	평가액	발행일	상환일	신용등급	비율
해당사항 없음						

- 채무증서

(단위 : 원,%)

종 목 명	액면가액	평가액	발행일	상환일	신용등급	비율
해당사항 없음						

- 장내파생상품

(단위 : 계약, 원)

종 목 명	매수(도) 구분	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	268	18,760,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	217	15,190,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	215	15,050,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	200	14,000,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	188	28,012,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	143	10,010,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	104	7,280,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	80	11,920,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	53	3,710,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	51	3,570,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	25	1,750,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	19	1,330,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	16	1,120,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	14	980,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	5	350,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	4	280,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	2	140,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	1	70,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	1	70,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	1	70,000	
KOSPI 200 콜옵션 070	매 도	1	70,000	
합계		1,608	133,732,000	0

- 장외파생상품

(단위 : 계약, 원)

종 목 명	매수(도) 구분	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
해당사항 없음				

- 부동산(임대)

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가액(보증금)	비고
	등기번호	취득일	평가액(임대료)	
해당사항 없음				

- 부동산(자금대여 및 차입)

(단위 : 원,%)

구분(대상)	대여(차입)기관	계약일자	대여(차입)금액	대여(차입)이율	상환(만기)일	비고
해당사항 없음						

- 실물자산

(단위 : 원)

종류	매입일	매입가	평가액	비고
해당사항 없음				

- 단기대출 및 예금

(단위 : 원,%)

구분	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	대출(예금)이자	상환(만기)일	비율
콜 1일물 4.75	대우증권	2007-02-15	22,800,000,000	2,967,122	2007-02-16	9.62
예금			33,384,700	275,676		0.01
합계			22,833,384,700	3,242,798		9.64

- 기타자산 및 특별자산

(단위 : 원,%)

구분	종 목 명	액면가액	평가액	비율
기타자산	유가증권매도미수금		12,390,258,767	5.23
기타자산	기타미수금		64,799,610	0.03
기타자산	미수배당금		3,588,111,275	1.51
기타자산	선납원천세		14,057,520	0.01
합계			16,057,227,172	6.77

- 유가증권대여 및 차입

(단위 : 원,%)

구분	대여기관	대여일자	대여수량	대여수수료	상환일	비율
해당사항 없음						

- 간접투자증권

(단위 : 원,%)

간접투자기구명	보유수량	취득가액	평가액	평가손익	비율
해당사항 없음					

5. 매매주식총수, 매매금액 및 매매회전율

(단위 : 주, 원,%)

매수		매도		매매회전율
수량	금액	수량	금액	
396,010	14,716,524,160	2,137,551	55,575,221,200	38.64

6. 운용의 개요 및 손익현황

- **운용개요:** 동 기간 중 국내 주식시장은 종합주가지수 기준으로 2.20% 상승하는 흐름을 보였습니다. 12월초까지 꾸준히 상승하던 국내 증시는 12월 국내 기관의 자금유입 둔화와 외국인 매도지속으로 한차례 조정을 보이기도 하였으나 이내 반등에 성공 전고점을 회복하며 한해를 마감하였습니다. 그러나 1월초 향후 실적전망 불투명과 국내 증시의 수급불안감이 겹치면서 한차례 급락하였습니다. 1350포인트를 저점으로 반등에 성공한 증시는 은행, 조선, 증권업종들에 대한 외국인 매수에 힘입어 최고가를 돌파에 성공하였습니다. 동 기간중 미국, 유럽, 일본, 중국을 비롯한 글로벌 증시 역시 연중 최고가를 경신하는 흐름을 보였습니다. 현재 포트폴리오는 삼성전자, KT, 삼성전자우, 한국전력, SK텔레콤, GS건설, 기업은행, 삼성화재우, KT&G, CJ우, S-Oil우 LG전자우, LG상사, 제일모직 등의 블루칩 종목과 대신증권우, 대한전선, 금호산업우, 휴스틸, 무림페이퍼 등 중소형 고배당주 종목으로 구성되어 있습니다. 기간 중 블루칩 포트폴리오 중에서는 POSCO, 우리금융, 신한지주, 기업은행, 국민은행, 삼성화재, LG화학, GS건설 등이 양호한 수익률을 보였으며, 삼성전자, LG전자우, 현대차2우B, 한국가스공사, 강원랜드 등의 수익률이 부진하였습니다. 고배당주 포트폴리오중에서는 STX조선, 부산은행, 예스코, LG상사, 웅진코웨이 등이 양호한 수익률을 보였으며, 금호산업우, 무림페이퍼, 대구백화점, 한미반도체 등의 수익률이 부진하였습니다. 펀드의 커버드콜 전략은 헷지 및 추가수익 확보를 위하여 실행하는 전략입니다. 향후에도 커버드콜 전략은 이전과 다름없이 주식편입비의 20% 범위 내에서 현재 지수 이상의 콜옵션을 지속적으로 매도해 나아갈 계획입니다.

(단위 : 백만원)

구분	평가손익		처분손익		
	전기	당기	전기	당기	
투자증권	주식	10,710	512	6,912	-519
	채권	-41	-118	78	-272
	기타투자증권	0	0	0	0
장내파생	85	58	393	-93	
장외파생	0	0	0	0	
부동산	0	0	0	0	
실물자산	0	0	0	0	
특별자산	0	0	0	0	
간접투자증권	0	0	0	0	

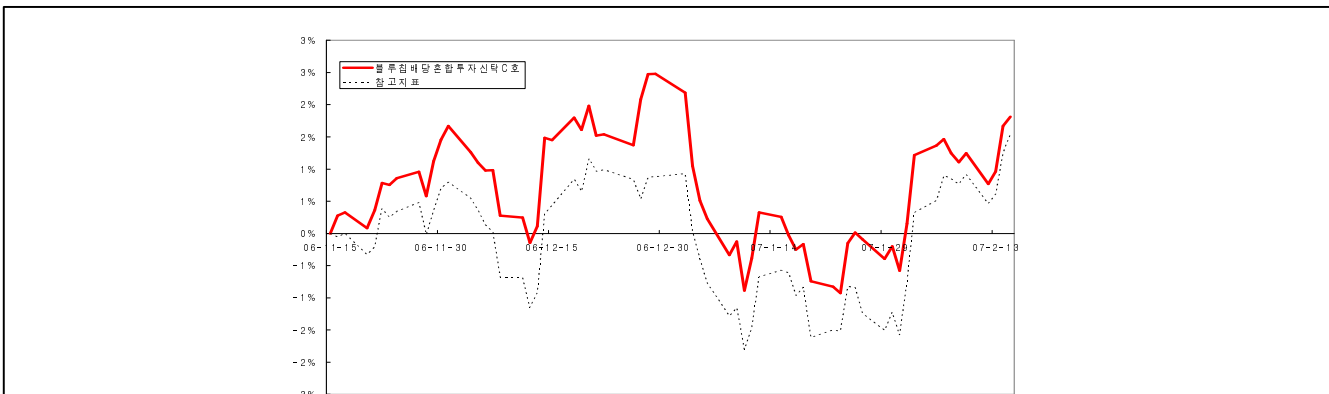
주) 기타손익의 당기내역 : 보수 : 1008, 수수료 : 10, 대손상각비 : 0, 기타이익 : 0, 배당수익 : 3589, 채권수입이자 : 1049, 유동수입이자 : 261, 수입수수료 : 0, 대손상각비환입 : 0, 상환이익 : 40

- **기간별 운용성과**

(단위 : %)

	1 개월	3 개월	6 개월	1 년	설정(등록)일 이후
수익률	1.55	1.81	7.66	7.34	40.99

※ **참고지표 :** KOSPI 50% + **블루칩그채권지수(국고채1~2년물) 50%**



※ **과거의 수익률이 미래의 수익률을 보장하지는 않습니다.**

- **보수 지급 현황**

(단위 : 백만원)

구분	전기	당기
운용보수	418	357
판매보수	722	616
수탁보수	23	19
사무관리보수	15	13

- **총보수,비용비율**

(단위 : 연환산)

구분	전기	당기
총보수,비용비율	1.66	1.73

7. 운용전문인력현황

성명	연령	주요 근무경력 및 기간	협회등록번호
이승준	1973년	Columbia Univ. Financial Math, 신영증권/미래에셋자산운용	06-02002-0034
허필석	1967년	KAIST Techno MBA, 장기신용/삼성증권	00-02002-0011
계상현	1974년	서강대 경영학, KTB	05-02002-0029

8. 중개회사별 거래금액, 수수료 및 그 비중

주식거래

(단위 : 백만원,%)

구분	12월			1월			2월		
	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중
골드만삭스증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	419	1.26	1/2
교보증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	1,043	1.04	2/2
굿모닝신한증권	0	0.00	0/0	1,627	1.63	17/12	3,969	3.97	9/6
대우증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	715	0.72	2/1
도이치증권	4,087	10.23	23/29	0	0.00	0/0	716	1.80	2/3
동양증권증권	39	0.04	0/0	2,903	2.91	30/22	0	0.00	0/0
리먼브러더스증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	616	1.54	1/3
액퀴리증권(구ING B.	1,018	2.55	6/7	362	0.91	4/7	2,011	5.04	5/8
메리츠증권	268	0.27	1/1	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0
메릴린치	1,574	3.94	9/11	0	0.00	0/0	1,253	3.13	3/5
모건스탠리	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	396	1.19	1/2
미래에셋증권	742	0.74	4/2	94	0.09	1/1	5,657	5.66	13/9
삼성증권	2,475	4.96	14/14	388	0.78	4/6	0	0.00	0/0
신영증권	946	0.95	5/3	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0
신흥증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	1,306	1.31	3/2
씨티글로벌마켓증권	1,042	3.13	6/9	0	0.00	0/0	4,093	12.30	10/20
우리투자증권	0	0.00	0/0	340	0.34	3/3	4,141	4.14	10/7
푸르덴셜증권	3,691	3.69	20/10	1,637	1.64	17/12	4,166	4.17	10/7
하나증권	164	0.16	1/0	202	0.20	2/2	322	0.32	1/1
한국투자증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	8,354	8.36	20/14
한누리투자증권	159	0.16	1/0	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0
한화증권	248	0.25	1/1	375	0.38	4/3	1,032	1.03	2/2
현대증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	30	0.03	0/0
ABN AMRO증권(주식)	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	1,996	4.00	5/7
CREDIT SUISSE	1,709	4.28	9/12	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0
NH투자증권(세종)	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	14	0.01	0/0
UBS증권	0	0.00	0/0	1,796	4.50	18/34	158	0.40	0/1

주식 외 투자증권 거래

(단위 : 백만원,%)

구분	12월			1월			2월		
	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중
굿모닝신한증권	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0	9,526	0.00	8/0
리딩증권	33,333	0.00	23/0	0	0.00	0/0	11,746	0.00	10/0
미래에셋증권	18,296	0.00	13/0	0	0.00	0/0	6,888	0.00	6/0
부국증권	13,953	0.00	10/0	15,209	0.00	25/0	11,212	0.00	9/0
신영증권	13,077	0.00	9/0	8,995	0.00	15/0	9,768	0.00	8/0
신흥증권	7,163	0.00	5/0	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0
우리은행(중개)	1,200	0.00	1/0	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0

이트레이드증권	9,722	0.00	7/0	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0
키움닷컴증권	0	0.00	0/0	6,200	0.00	10/0	12,082	0.00	10/0
푸르덴셜증권	14,500	0.00	10/0	0	0.00	0/0	18,024	0.00	15/0
한국자금중개	0	0.00	0/0	10,029	0.00	17/0	7,022	0.00	6/0
한양증권	7,154	0.00	5/0	7,998	0.00	13/0	2,014	0.00	2/0
KGI증권	6,401	0.00	4/0	5,044	0.00	8/0	14,300	0.00	12/0
NH투자증권(세종)	14,230	0.00	10/0	6,356	0.00	11/0	16,085	0.00	14/0
SK증권	6,006	0.00	4/0	0	0.00	0/0	0	0.00	0/0

장내파생상품 거래

(단위 : 백만원,%)

구분	12월			1월			2월		
	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중	거래금액	수수료	비중
하나증권	126	0.38	100/100	358	1.07	100/100	273	0.82	100/100

※ 비중의 상위란 %는 거래금액 기준 비중, 하위란 %는 수수료 기준 비중임

9. 이해관계인과의 거래에 관한 사항

(단위 : 백만원)

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

10. 의결권공시대상법인등에 대한 의결권행사여부 및 그 내용

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)				불행사사유
				찬성	반대	불행사	중립	
강원랜드	061122	61,600		61,600	0	0	0	
대한전선	061128	196,320		196,320	0	0	0	
대우건설	061222	122,000		122,000	0	0	0	
대우건설	061222	122,000		122,000	0	0	0	
대우건설	061222	122,000		122,000	0	0	0	

11. 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 이용할 수 있습니다.

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