

# 자 산 운 용 보 고 서

## 1. 집합투자기구의 개요

### ▶ 기본정보

『적용법률: 자본시장법(간투법에서 전환)』

위험등급 : 3등급

집합투자기구명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이더스 블루칩배당 30 증권 투자회사(채권혼합)		33604	
집합투자기구의 종류	투자회사/증권(혼합채권)/개방형	최초설정일	2002-01-04
운용기간	3개월(2009-04-04 ~ 2009-07-03)	존속기간	추가형
신탁업자	국민은행	일반사무관리회사	SC제일펀드서비스
투자매매·중개업자	하나대투증권 (주)신한은행 현대증권 한국외환은행		
상품의 특징	본 상품은 안정형 펀드로서 4개의 투자전략(포트폴리오 헤지전략, 선물시스템트레이딩, 옵션합성전략, 이벤트 차익거래)을 복합적으로 사용하여 안정적인 수익을 달성을 목표로 합니다. 주요전략인 포트폴리오 헤지는 주식자산을 20~30% 범위에서 편입하고 해당 자산만큼 선물을 매도하여 펀드는 주가변동방향과 관계없이 주식 포트폴리오의 지수 이상 초과수익 부분을 수익으로 추구하고, 채권의 경우 만기보유전략과 같은 소극적인 채권운용전략과 함께 이자율 예측 및 채권발행기관에 대한 신용분석 등에 의한 적극적인 매매 전략도 병행하여 수익을 추구하고 있습니다.		

☞ 위험등급 : 투자대상 자산의 종류 및 위험도 등을 감안하여 1등급(매우 높은 위험) 부터 5등급(매우 낮은 위험) 까지 투자위험 등급을 5단계로 분류함.

☞ 1등급 - 매우 높은 위험, 2등급 - 높은 위험, 3등급 - 중간 위험, 4등급 - 낮은 위험, 5등급 - 매우 낮은 위험

### ▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	11,647,995,708	12,046,364,152	3.42
부채 총액 (B)	197,571,675	327,300,345	65.66
순자산총액 (C=A-B)	11,450,424,033	11,719,063,807	2.35
발행 수익증권 총 좌수 (D)	12,337,380,521	12,074,946,798	-2.13
기준가격 (E=C/D*1000)	928.11	970.53	4.57

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

### ▶ 분배금 지급내역

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 지급일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
해당사항 없음					

## 2. 운용경과 및 수익률현황

### ▶ 운용경과

동 기간동안 펀드 수익률은 4.57% 이며 비교지수는 3.73% 상승하였습니다. 비교지수 대비 수익률이 좋았던 요인으로는 분기 초반 이후 주식편입비를 25% 이상 유지하였던 점과 중국원양자원, 우림기계 등 공모주 편입을 통한 추가 수익달성 그리고 LG이노텍, 엔씨소프트 등 단기반등을 기대하고 접근했던 종목들의 수익률이 양호했기 때문입니다. 종목별로 성과를 보면, 외환은행, 기업은행, 엔씨소프트 등 수익률이 좋았으며, 두산중공업, 두산인프라코어, 현대건설 등의 수익률이 부진하였습니다.

▶ **운용계획**

각국의 정책 대응등으로 인해 미국의 금융위기는 어느 정도 진정 된 것으로 판단되며 주가가 재차 큰 폭으로 하락할 가능성은 줄어들고 있다고 분석됩니다. 2분기 실적은 시장 기대치 이상으로 나오고 있으며 유동성을 바탕으로 등락을 거듭했던 지수가 안정세를 찾아갈 것으로 예측하고 있습니다. 다만 아직도 높은 실업률, 3분기 실적에 대한 미지수 등이 남아 있기 때문에 현시점에서 시장이 큰 폭으로 상승할 가능성은 적어 보입니다. 업종별로는 선순환이 예상되는데 그 동안 급등한 자동차/IT 업종 보다는 철강, 기계, 조선 업종의 상승 가능성이 높아 보입니다. 이에 따라 편입비는 25% 내외를 유지하되 예상 지수대에 따라 적극적인 비중조정과 매매를 통하여 초과수익을 추구할 계획입니다. 콜옵션 매도 부분은 시장 변동성이 증가하였으므로, 콜 프리미엄을 적정수준으로 얻을 수 있는 한도내에서는 평소보다 높은 행사가의 콜옵션을 매도할 계획입니다. 업종의 비중을 소폭 축소하고 이미 큰 폭으로 상승한 건설 업종의 비중 역시 소폭 축소시킬 계획입니다. 1분기 실적 발표 이후 조선업종의 주가가 하락한다면 비중을 확대할 계획이 있습니다. 채권운용은 앞서 기술한 바와 같이 국고채 및 통안채 중심의 투자로 유동성을 높게 가져가며 듀레이션도 +1.0, -1.0년을 기준으로 조정할 계획입니다.

▶ **기간수익률**

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	-0.82	4.57	6.47	4.51	2.24
비교지수	0.12	3.73	8.34	6.16	3.68

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

\* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

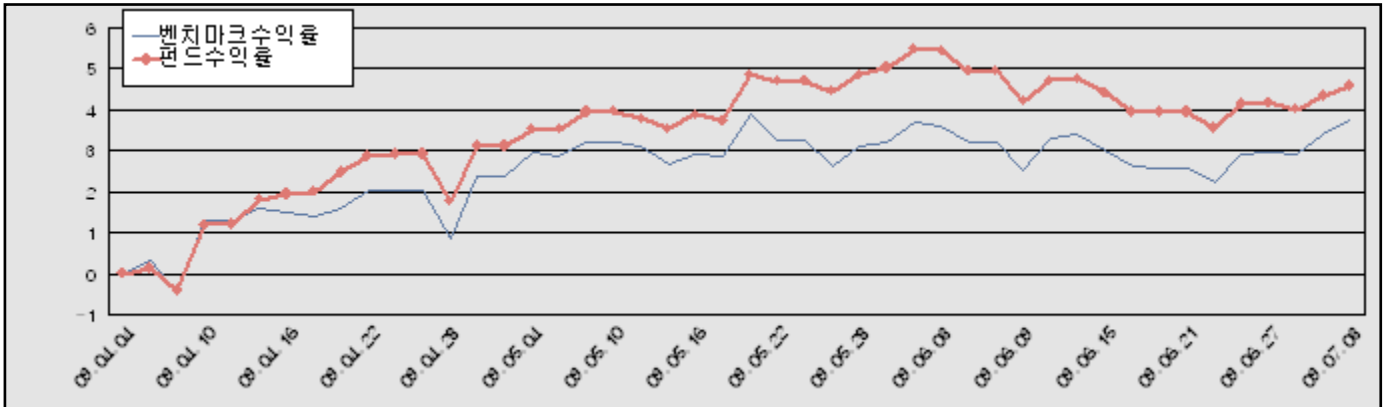
▶ **연평균 수익률**

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구	2.24	-0.52	3.92	7.26
비교지수	3.68	2.27	6.08	4.41

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

\* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.



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

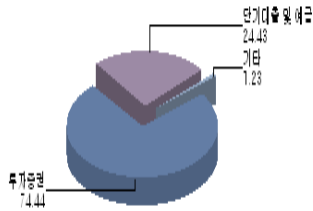
▶ **손익현황**

(단위 : 백만원, %)

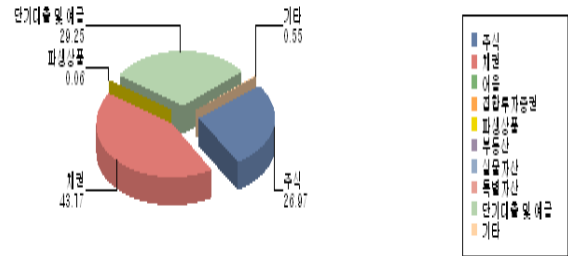
구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	491	50	0	0	17	0	0	0	0	9	-47	519
전기손익	348	-102	0	0	-6	0	0	0	0	13	-45	207

### 3. 자산현황

#### ▶ 자산구성현황 (전기)



#### ▶ 자산구성현황 (당기)



(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	3,249 (26.97)	5,201 (43.17)	0 (0.00)	0 (0.00)	7 (0.06)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	3,523 (29.25)	66 (0.55)	12,046 (100.00)
합계	3,249 (26.97)	5,201 (43.17)	0 (0.00)	0 (0.00)	7 (0.06)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	3,523 (29.25)	66 (0.55)	12,046 (100.00)

※ ( )내는 자산총액에 대한 비중

#### ▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	채권	국고0500-1103	25.82	2	채권	국고0525-1209	17.35
3	단기대출및예금	예금	12.64	4	단기대출및예금	콜 3일물 2.03	8.30
5	단기대출및예금	콜 3일물 1.75	8.30	6	주식	삼성전자	3.34
7	주식	POSCO	1.52	8	주식	LG전자	1.38
9	주식	현대차	1.20	10	주식	KT	1.01

#### ▶ 주식

(단위 : 주.원, %)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	670	402,670,000	12.39
POSCO	422	183,570,000	5.65
LG전자	1,400	165,900,000	5.11
현대차	1,990	144,872,000	4.46
KT	3,250	122,200,000	3.76

※ 상위 5개 종목만 기재함. ※ 비중 : 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

#### ▶ 채권

(단위 : 원, %)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고0500-1103	3,000,000,000	3,110,628,000	2006-03-10	2011-03-10	무보증(미등록)		59.81
국고0525-1209	2,000,000,000	2,090,248,000	2007-09-10	2012-09-10	무보증(미등록)		40.19

※ 상위 5개 종목만 기재함. ※ 비중 : 채권 총액중 해당 종목이 차지하는 비중.

#### ▶ 어음

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

※ 상위 5개 종목만 기재함. ※ 비중 : 어음 및 채무증서 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ **집합투자증권**

(단위 : 원,%)

종목	취득일자	취득가액	평가액	비고
해당사항 없음				

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ **장내파생상품**

(단위 : 계약,원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 C 200907 192.5	매도	46	276,000	
합계		46	276,000	0

▶ **장외파생상품**

(단위 : 원)

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

▶ **부동산(임대)**

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가격	보증금	비고
	등기번호	취득일	평가금액	임대수입	
해당사항 없음					

▶ **부동산(자금대여 및 차입)**

(단위 : 원,%)

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

▶ **특별자산 (실물자산)**

(단위 : 원)

종류	취득일자	취득가격	평가금액	비고
해당사항 없음				

▶ **단기대출 및 예금**

(단위 : 원,%)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 3일물 2.03	교보증권	2009-07-03	1,000,057,216	2.03	2009-07-06	
콜 3일물 1.75	전북은행	2009-07-03	1,000,049,545	1.75	2009-07-06	
예금	국민은행		1,522,931,711			

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ **기타**

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	64,271,430	
미수배당금	2,056,500	
합계	66,327,930	

## 4. 투자운용전문인력 현황

### ▶ 책임운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위 (연령)	운용중인 다른 집합투자기구 현황		주요 경력 및 운용실적(최근5년)	협회등록번호
			기구 수	운용 규모		
박정환	2003-09-29	본부장 1964년	134	2,984, 164	서울대학교 대학원 경영학과 (경영학 석사) 제일경제연구소 연구소, 국민투자신탁, 현대투자신탁, Sk투자신탁, 아이투자신탁, 한국투자신탁 채권운용팀 現 마이다스에셋 자산운용(주) 채권운용본부장	03-02002-0026
허필석	2002-01-04	대표이사 1967년	134	2,984, 164	서울대학교 대학원 경영학 석사, KAIST Techno MBA, 미국 일리노이대학 금융공학과정 연수, CFA장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부 現 마이다스에셋 자산운용(주) 주식운용본부장 ☞ 주요운용펀드 : 마이다스블록채매당좌권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
유선아	2002-09-09	운용역 1972년	134	2,984, 164	대신투자자문(주) 국내자문팀, 대신투자신탁운용(주) 채권운용팀 現 마이다스에셋자산운용(주) 채권운용본부 과장 (2000.05-현재)	01-02002-0018
이승준	2005-06-23	팀장 1973년	134	2,984, 164	Columbia University Financial Math신영증권, 미래에셋자산운용 매니저 現 마이다스에셋자산운용(주) 주식운용2팀장 ☞ 주요운용펀드 : 마이다스액티브증권투자회사(주식)	06-02002-0034
최영철	2008-10-08	팀장 1973년	134	2,984, 164	서울대학교 계산통계학과 (경제학 부전공) Bain & Company Consultant Tristar(美 Hedge Fund 운용사) 파견연수 現 마이다스에셋자산운용(주) 주식운용본부 팀장 ☞ 주요운용펀드 : 마이다스베스트트리오증권투자신탁(주식)	08-02002-0046
오종록	2008-05-16	운용역 1973년	134	2,984, 164	서울대학교 경제학과 졸업교보투신, 피데스투자자문, 한누리투자증권, 이트레이드증권 채권운용팀, 알리안츠생명보험 자산운용실 現 마이다스에셋자산운용(주) 채권운용본부 차장 ☞ 주요운용펀드 : 마이다스퇴적연금채권모투자신탁	05-02002-0028
송형섭	2006-04-28	운용역 1974년	134	2,984, 164	서울대학교 경영대학교 석사과정랜드마크자산운용본부, 유리스투자자문 주식운용본부 現 마이다스에셋자산운용(주) 주식운용2팀 과장 ☞ 주요운용펀드 : 월드 In Best 주식 재간점 모투자신탁	06-02002-0033

\* 성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모 : 펀드수(7) 운용규모(367,413)

## 5. 비용현황

### ▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
집합투자업자	13	0.11	13	0.11	
투자매매/중개업자	29	0.25	30	0.25	
신탁업자	1	0.01	1	0.01	
일반사무관리회사	1	0.01	1	0.01	
보수 합계	44	0.38	45	0.38	

\* 집합투자기구의 순자산총액 대비 비율

### ▶ 총보수비용 비율

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	1.78	1.83
중개수수료비율	0.17	0.21

\* 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 집합투자기구에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냄. 또한 모자형의 경우 상위 집합투자기구에서 발생한 비용을 하위 집합투자기구가 차지하는 비율대로 안분하여, 합산(합성 총보수·비용비율)하여

## 6. 투자자산매매내역

### ▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 주,원,%)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
84,977	2,341,111,905	90,636	2,673,709,800	85.51	346.81

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

### ▶ 종개회사별 거래내역

#### ■ 주식

(단위 : 백만원,%)

구분	2009-04-04 ~ 2009-05-03			2009-05-04 ~ 2009-06-03			2009-06-04 ~ 2009-07-03		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	389 (25.73)	0.39 (24.05)	0.10	110 (6.11)	0.11 (4.69)	0.10	56 (3.28)	0.06 (2.82)	0.10

#### ■ 그 밖의 증권

(단위 : 백만원,%)

구분	2009-04-04 ~ 2009-05-03			2009-05-04 ~ 2009-06-03			2009-06-04 ~ 2009-07-03		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	10,803 (33.66)	0.00 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0.00 (0.00)	0.00	2,966 (10.28)	0.00 (0.00)	0.00

#### ■ 파생상품

(단위 : 백만원,%)

구분	2009-04-04 ~ 2009-05-03			2009-05-04 ~ 2009-06-03			2009-06-04 ~ 2009-07-03		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	16 (100.00)	0.05 (100.00)	0.30	15 (100.00)	0.04 (100.00)	0.30	7 (100.00)	0.02 (100.00)	0.30

※ 비관계회사는 상위 1개사만을 명시합니다.

## 7. 이해관계인과의 거래 및 계열회사 발행증권 거래 현황

### ▶ 이해관계인과의 거래

(단위 : 백만원)

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

### ▶ 계열회사 발행증권 보유현황 및 비율

#### ◆ 해당집합투자기구

(단위 : 주,원,%)

종목명	보유수량	보유(평가)금액	보유비율
해당사항 없음			

#### ◆ 전체집합투자기구

(단위 : 주,원,%)

자산의 종류	보유수량/액면가액	보유(평가)금액	보유비율
해당사항 없음			

**▶ 계열회사 발행증권 거래 내역**

(단위 : 주, 원)

거래구분	자산의 종류	종목명	거래상대방	거래수량	거래금액	거래일자
해당사항 없음						

**▶ 계열회사 발행증권 대차거래 내역**

(단위 : 주, 백만원)

종목명	구분	거래상대방	거래금액	거래조건	거래일자
해당사항 없음					

**8. 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사 여부 및 그 내용**

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)			불행사 사유
				찬성	반대	불행사	
※ 중립적 의결권 행사 종목 : 없음							

**공지사항**

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 블루칩배당 30 증권 투자회사(채권혼합)의 집합투자업자인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 신탁업자인 '국민은행'의 확인을 받아 투자매매, 중개업자를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 집합투자기구의 신탁업자 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용 <http://www.midasasset.co.kr> / 02-3787-3500  
 금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>