

자 산 운 용 보 고 서

1. 집합투자기구의 개요

▶ 기본정보

『적용법률: 자본시장법(간투법에서 전환)』

위험등급 : 2등급

집합투자기구명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이다스 블루칩배당 증권 투자회사(주식)		37353	
집합투자기구의 종류	투자회사/증권(주식형)/개방형	최초설정일	2003-05-15
운용기간	3개월(2009-08-15 ~ 2009-11-14)	존속기간	추가형
신탁업자	하나은행(서울)	일반사무관리회사	SC제일펀드서비스
투자매매·중개업자	SC제일은행 국민은행 대우증권 신한은행 하나대투증권 한국투자증권 교보증권 미래에셋 신한금융투자 메리츠증권 현대증권 키움닷컴증권		
상품의 특징	본 상품은 주식형투자회사로서 투자대상 기업의 수익성, 성장성, 시장상황 등을 고려한 주식투자를 통해 자본이득과 배당소득을 추구합니다. 특히, 시가총액 상위 우량주와 배당성향이 높은 주식에 주로 투자하여 배당수익을 얻으면서도 주가 상승 시 수익률을 제고하는 것을 목표로 합니다. 투자회사 자산의 60%이상은 국내주식 등에 투자하고 투자회사 자산의 40%이하는 국공채, 지방채, 특수채, 신용등급 A-이상인 회사가 발행하는 회사채(사모사채 제외), 기타 유동성 자산 등에 투자합니다. 한편, 현물주식을 보유하면서 현재 주가보다 높은 행사가격의 콜옵션을 매도하는 커버드콜 전략을 활용하여 주가하락 위험을 부분적으로 방어하면서 추가수익을 추구하는 방향으로 운용할 것입니다.		

☞ 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)	79,407,105,594	73,809,808,323	-7.05
부채 총액 (B)	2,532,564,054	1,142,100,859	-54.90
순자산총액 (C=A-B)	76,874,541,540	72,667,707,464	-5.47
발행 수익증권 총 좌수 (D)	85,092,702,682	76,915,521,152	-9.61
기준가격 (E=C/D*1000)	903.42	944.77	4.58

※ 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 기간 동안 펀드 수익률은 4.58%이며 비교지수는 -0.67% 기록하여 비교지수 대비 5.25% 높은 수익률을 기록하였습니다. 동 펀드가 비교지수 대비 높은 수익률을 기록한 것은 실적 안정성이 높은 종목군 위주로 포트폴리오가 유지 되었으며, 업종별로는 비중을 확대 했던 전기전자, 금융업종의 수익률이 좋았기 때문입니다. 또한 개별적인 주가 상승요인이 있다고 판단하여 편입한 녹십자, LG이노텍, GS홈쇼핑 등이 상대적으로 양호한 흐름을 보였던 것도 비교지수 이상의 성과를 내는데 일조하였습니다. 기간 중 업종별로는 경기회복에 대한 기대감과, 양호한 실적을 바탕으로 철강 업종이 큰 폭으로 상승하였으며, 글로벌 금융위기 안정에 따라 금융업종 역시 큰 폭 상승하였습니다. 안전자산에 대한 선호도가 줄어들면서 방어적인 통신업종은 큰 폭으로 시장을 하회 하였습니다. 또한 신규 수주에 대한 기대감이 줄어들면서 조선업종 역시 시장을 하회 하였습니다. 종목별로 살펴 보면 글로벌, 녹십자, GS홈쇼핑, CJ제일제당 등의 수익률이 좋았으며, 한진중공업, 효성, 대우증권 등의 수익률이 상대적으로 부진하였습니다.

▶ 운용계획

3분기까지 매우 양호한 실적을 보인 시장은 4분기 역시 최고수준의 이익을 보일 것으로 예상되는 국면입니다. 다만, 시장의 기대치 역시 매우 높아진 상황임을 감안하고, 금융위기 이후 풀린 유동성에 대한 회수시기가 마냥 미루어질 수 많은 없다는 점을 고려해 볼 때, 올해 보여줬던 시장의 가파른 상승세는 속도조절이 불가피해 보입니다. 향후 내수주, 배당주, 내년 실적호전주 위주로 높은 수익률을 기록할 것으로 보여 이에 따라 섹터별 순환매에 대비한 포트폴리오 구축에 힘쓸 예정이며, 연말이 다가올수록 고배당주 편입비율을 점진적으로 늘릴 계획입니다. 향후 한 분기 동안 주식시장은 큰 폭의 상승을 기대하기는 힘들다고 예상하며, 하락 리스크에 대비 하여야 한다고 판단합니다. 향후 한 분기도 종목/업종별로는 여전히 높은 변동성이 유지될 것으로 판단하여 주식편입비율은 85% 내외를 유지하되, 예상 지수범위에 따라 적극적인 비중조정과 매매를 통하여 초과수익을 추구할 계획입니다. 이미 큰 폭으로 상승한 건설 업종의 비중 소폭 축소 시킬 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	-2.05	4.58	19.42	35.53	50.85
비교지수	-3.44	-0.67	10.76	24.09	33.79

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 75% + CD금리 25%

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

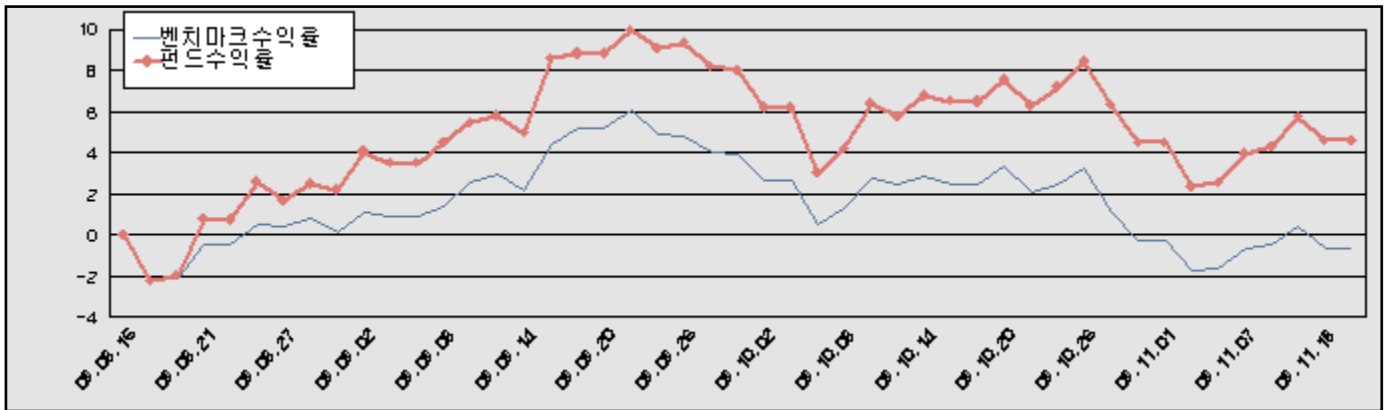
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구	50.85	-6.11	8.42	14.32
비교지수	33.79	-6.23	4.83	11.01

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 75% + CD금리 25%

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



비교지수(Bench Mark) = KOSPI 75% + CD금리 25%

▶ 손익현황

(단위 : 백만원, %)

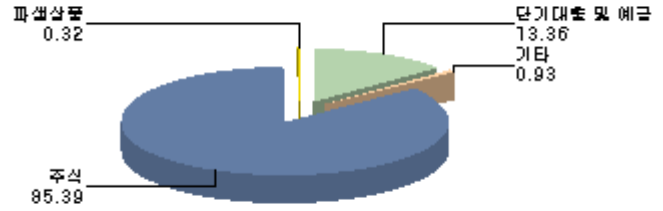
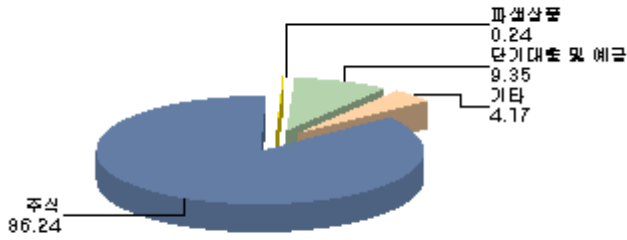
구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	4,153	0	0	0	690	0	0	0	0	42	5	4,890
전기손익	12,780	0	0	0	404	0	0	0	0	37	44	13,266

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

[전기]

[당기]



(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	63,023 (85.39)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	237 (0.32)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	9,864 (13.36)	685 (0.93)	73,810 (100.00)
합계	63,023 (85.39)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	237 (0.32)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	9,864 (13.36)	685 (0.93)	73,810 (100.00)

* ()내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	11.96	2	단기대출및예금	콜 3일물 1.80	9.48
3	주식	POSCO	6.46	4	주식	현대건설	5.68
5	주식	신한지주	4.03	6	단기대출및예금	콜 3일물 2.05	3.79
7	주식	한국전력	3.52	8	주식	KB금융	3.50
9	주식	현대차	2.25	10	주식	현대제철	2.21

▶ 주식

(단위 : 주, 원, %)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	12,363	8,827,182,000	14.01
POSCO	8,775	4,764,825,000	7.56
현대건설	59,858	4,190,060,000	6.65
신한지주	62,197	2,973,016,600	4.72
한국전력	77,470	2,599,118,500	4.12

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

▶ 채권

(단위 : 원, %)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

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

▶ 어음 및 기타증권

(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 200912 220.0	매도	1,680	114,240,000	
합계		1,680	114,240,000	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 1.80	신한은행	2009-11-13	7,000,696,010	1.80	2009-11-16	
콜 3일물 2.05	교보증권	2009-11-13	2,800,316,760	2.05	2009-11-16	
예금	하나은행(서울)		63,018,133			

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ **기타**

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	685,403,420	
합계	685,403,420	

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		
허필석	2003-06-13	대표이사 1967년	36	1,730,390	서울대학교 대학원 경영학 석사 KAIST Techno MBA, CFA 장기신용은행 금융공학팀 삼성증권 자금부 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 ☞주요운용펀드 : 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
이승준	2005-06-23	팀장 1973년	36	1,730,390	Columbia University Financial Math 신영증권 미래에셋자산운용 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 ☞주요운용펀드 : 마이다스액티브증권투자회사(주식)	06-02002-0034
최영철	2008-10-08	팀장 1973년	36	1,730,390	서울대학교 계산통계학과 (경제학 부전공) Bain & Company Consultant 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 ☞주요운용펀드 : 마이다스베스트트리오증권투자신탁(주식)	08-02002-0046
송형섭	2006-04-28	운용역 1974년	36	1,730,390	서울대학교 경영대학교 석사 랜드마크자산운용 유리스투자자문 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 차장 ☞주요운용펀드 : 월드 In Best 주식 재간접 모투자신탁	06-02002-0033

※ 성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모 : 펀드수(5) 운용규모(189,644)

5. 비용현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
집합투자업자	121	0.16	124	0.16	
투자매매/중개업자	93	0.13	95	0.13	
신탁업자	4	0.01	4	0.01	
일반사무관리회사	7	0.01	8	0.01	
보수 합계	225	0.30	230	0.30	

※ 집합투자기구의 순자산총액 대비 비율

▶ 총보수비용 비율

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	1.84	1.65
중개수수료비율	0.59	0.42

※ 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 보여줌.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위 : 주,원,%)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
716,024	28,412,074,650	950,817	37,447,764,560	56.10	225.01

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율.

▶ 중개회사별 거래내역

■ 주식

(단위 : 백만원, %)

구분	2009-08-15 ~ 2009-09-14			2009-09-15 ~ 2009-10-14			2009-10-15 ~ 2009-11-14		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	3,389 (12.64)	3.39 (9.71)	0.10	4,041 (16.20)	4.04 (15.03)	0.10	638 (4.52)	0.64 (3.55)	0.10

■ 그 밖의 증권

(단위 : 백만원, %)

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

■ 파생상품

(단위 : 백만원, %)

구분	2009-08-15 ~ 2009-09-14			2009-09-15 ~ 2009-10-14			2009-10-15 ~ 2009-11-14		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	0 (0.00)	0.00 (0.00)	0.00	219 (100.00)	0.66 (100.00)	0.30	176 (100.00)	0.53 (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	
한국전력	090910	68,400	1. 상임이사 선임의 건	68,400	0	0	

※ 중립적 의결권 행사 종목 : 없음

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 블루칩배당 증권 투자회사(주식)의 집합투자업자인 마이다스에셋자산운용이 작성하여
 신탁업자인 '하나은행(서울)'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>