

자 산 운 용 보 고 서

1. 집합투자기구의 개요

▶ 기본정보

『적용법률: 자본시장법(간투법에서 전환)』

위험등급 : 3등급

집합투자기구명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이다스 블루칩배당 30 증권 투자회사(채권혼합)		33604	
집합투자기구의 종류	투자회사/증권(혼합채권)/개방형	최초설정일	2002-01-04
운용기간	3개월(2009-10-04 ~ 2010-01-03)	존속기간	추가형
집합투자업자	마이다스에셋자산운용		
신탁업자	국민은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
투자매매·중개업자	하나대투증권 신한은행 한국외환은행 현대증권		
상품의 특징	본 상품은 안정형 펀드로서 4개의 투자전략(포트폴리오 헤지전략, 선물시스템트레이딩, 옵션합성전략, 이벤트 차익거래)을 복합적으로 사용하여 안정적인 수익률 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
(A)	10,681,300,503	9,993,800,532	-6.44
(B)	184,345,381	124,681,927	-32.37
(C=A-B)	10,496,955,122	9,869,118,605	-5.98
(D)	10,314,530,619	9,579,556,564	-7.13
가 (E=C/D*1000)	1,017.69	1,030.23	1.23

) 가 가 (), () 가 . () 가

※ 분배금내역

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 지급일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2010-01-03	290	9,579,556,564	1,030.23	1,000.00	블루칩배당30(채혼)

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 1.23% 이며 비교지수는 1.70% 상승하였습니다. 비교지수 대비 수익률이 다소 낮았던 요인으로는 개별종목성과 기대감으로 접근했던 아이앤씨, 아트라스BX 등의 수익률 좋지 않았기 때문입니다. 또한 상대적으로 수익률이 좋지 않았던 자동차, IT, 금융 비중이 상대적으로 높았기 때문입니다. 종목별 성과를 보면, POSCO, GS건설, LG디스플레이 등의 수익률이 좋았으며, 삼성화재, S-Oil, 우리금융 등의 수익률이 부진하였습니다. 동 기간 중 경기회복에 대한 기대감과, 양호한 실적을 바탕으로 철강 업종이 큰 폭으로 상승하였습니다. 반면, 안전자산에 대한 선호도가 줄어 들면서 방어적인 통신업종은 큰 폭으로 시장을 하회 하였습니다. 또한 환율 하락에 대한 우려로 인하여 IT, 자동차 업종도 시장을 하회 하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

그 동안 국내 증시의 상승을 이끈 것은 세계적인 유동성 과잉공급과 국내경제지표의 빠른 회복이었으며 3,4분기 기업의 실적상승이 정점에 다다른 것으로 분석됨에 따라 2009년에 보여줬던 시장의 가파른 상승세는 속도조절 단계에 진입할 것으로 예상됩니다. 향후 내수주, 배당주, 2010년 실적호전주 위주로 높은 수익률을 기록할 것으로 예상함에 따라 섹터별 순환매에 대비한 포트폴리오 구축에 힘을 생각합니다. 향후 한 분기 동안 주식시장은 큰 폭의 상승을 기대하기는 힘들다고 판단하며, 금리, 환율 같은 거시경제 변수가 주식시장에 영향을 끼칠 것으로 예상하고 있어 지난 분기에 비해서는 다소 보수적으로 운용하며 하락 리스크에 대비 하여야 한다고 판단합니다. 향후 펀드 운용은 이미 큰 폭으로 상승한 철강 업종과 내년 전망이 좋지 않은 화학업종의 비중을 소폭 축소 시킬 계획이며, 해외 수주가 기대되는 건설업종과, 소비심리 개선에 수혜를 입을 것으로 예측되는 소매업종 비중을 늘릴 계획입니다. 채권운용은 앞서 기술한 바와 같이 국고채 및 통안채 중심의 투자로 유동성을 높게 가져가며, 듀레이션도 1.0년을 기준으로 조정 할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기	0.87	1.23	6.15	11.00	13.02
비교지수	1.17	1.70	6.72	10.70	15.63

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

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

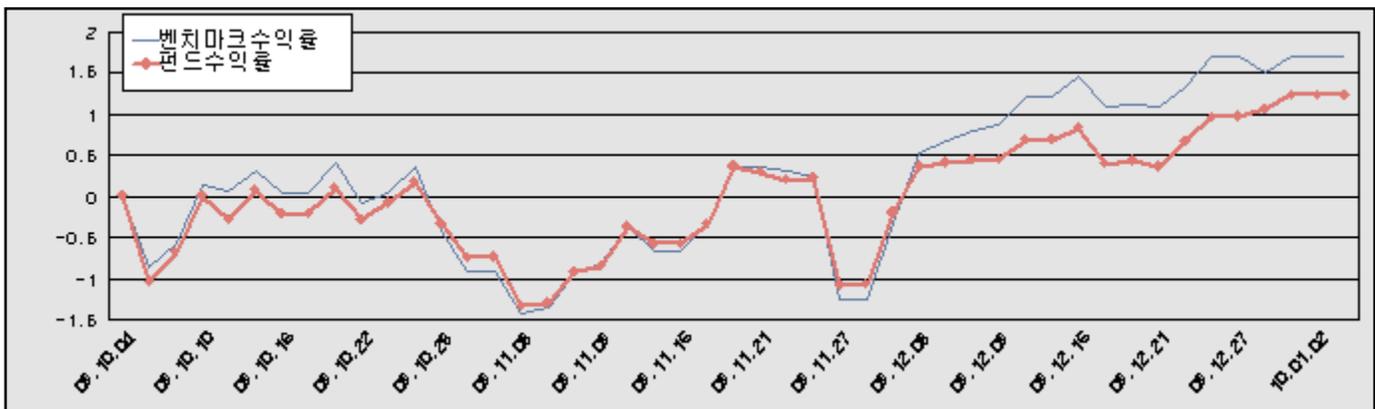
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기	13.02	1.50	4.61	7.31
비교지수	15.63	4.35	6.88	4.32

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%

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	110	10	0	0	9	0	0	0	0	9	-16	123
전기손익	581	17	0	0	-10	0	0	0	0	9	-46	550

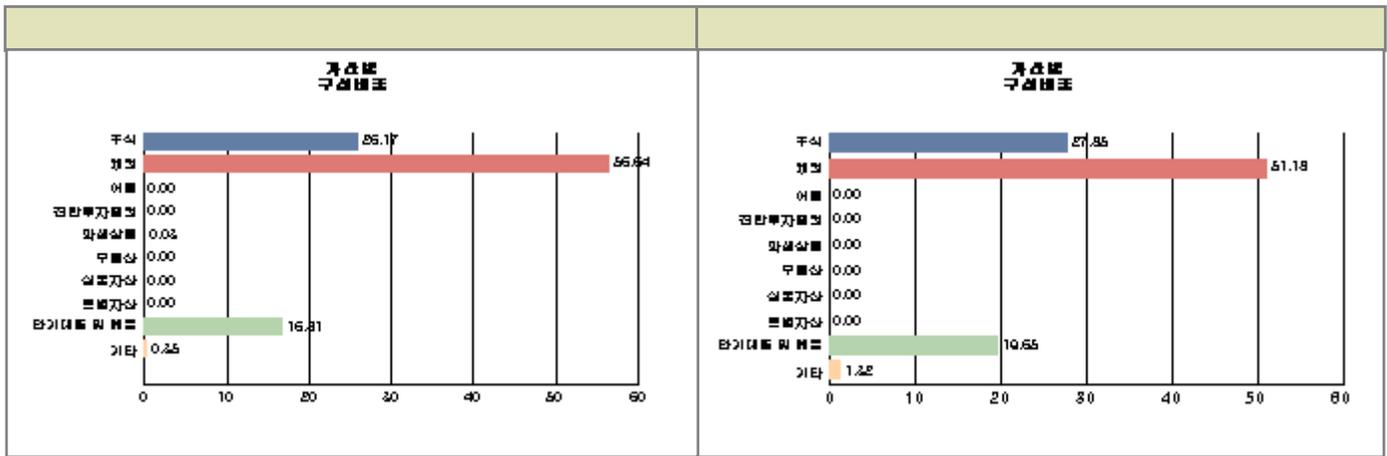
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(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	2,783 (27.85)	5,115 (51.18)	0	0	0	0	0	0	0	1,963 (19.65)	132 (1.32)	9,994 (100.00)
합계	2,783 (27.85)	5,115 (51.18)	0	0	0	0	0	0	0	1,963 (19.65)	132 (1.32)	9,994 (100.00)

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



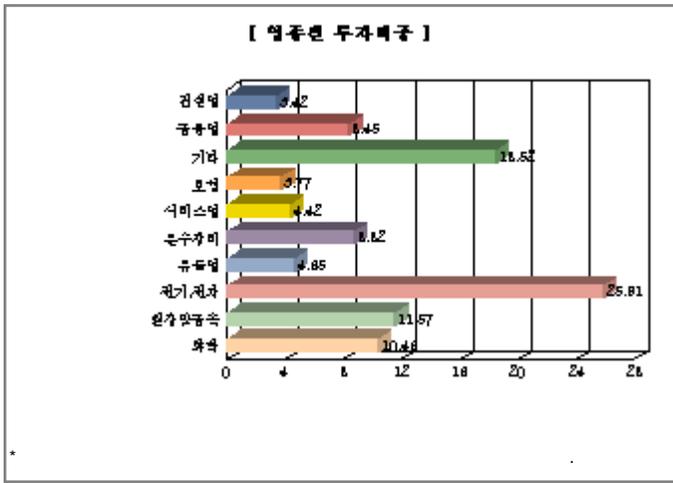
▶ 업종별, 국가별 투자비중

주식투자 상위 10종목

종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
삼성전자	18.66	POSCO	8.57
현대차	3.48	LG화학	3.01
현대모비스	2.89	KB금융	2.87
신한지주	2.85	LG디스플레이	2.62
LG전자	2.62	한국전력	2.59

업종별 투자비중

종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
전기, 전자	25.91	철강및금속	11.57
화학	10.46	운수장비	8.82
금융업	8.45	유통업	4.65
서비스업	4.42	보험	3.77
건설업	3.42	기타	18.52



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	채권 통안0464-1110	40.68	2	단기대출및예금 예금	10.64
3	채권 국고0575-1309	10.50	4	단기대출및예금 콜 4일물 2.05	9.01
5	주식 삼성전자	5.20	6	주식 POSCO	2.39
7	주식 현대차	0.97	8	주식 LG화학	0.84
9	주식 현대모비스	0.81	10	주식 KB금융	0.80

(<http://dis.kofia.or.kr>)

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

(단위 : 주.원.%)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	650	519,350,000	18.66
POSCO	386	238,548,000	8.57
현대차	800	96,800,000	3.48
LG화학	367	83,859,500	3.01
현대모비스	471	80,541,000	2.89

* 비중 : 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

■ 상위 5개 종목

(단위 : 원.%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안0464-1110	4,000,000,000	4,065,844,000	2009-10-04	2011-10-04	무보증(미등록)		79.48
국고0575-1309	1,000,000,000	1,049,407,000	2008-09-10	2013-09-10	무보증(미등록)		20.52

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

▶ 어음

■ 상위 5개 종목

(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

■ 상위 5개 종목

(단위 : 원,%)

종목	종류	집합투자업자	설정원본	순자산금액	취득일	비중
해당사항 없음						

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약,원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 C 201001 227.5	매도	34	4,148,000	
합계		34	4,148,000	0

) 가 5%

▶ 장외파생상품

(단위 : 원)

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

) 가 5%

▶ 부동산(임대)

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가격	보증금	비고
	등기번호	취득일	평가금액	임대수입	
해당사항 없음					

) 가 5%

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

(단위 : 원,%)

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

) 가 5%

▶ 특별자산

(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 4일물 2.05	교보증권	2009-12-31	900,202,191	2.05	2010-01-04	
예금	국민은행		1,063,104,531	0.10		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	104,348,360	
미수배당금	27,908,150	
합계	132,256,510	

) 가 5%

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위	운용중인 다른 진한투자기구 현황		주요 경력 및 운용내역(최근5년)	협회등록번호
			기구 수	운용 규모		
허필석	2002-01-25	대표이사 1967년	23	1,461,741	서울대학교 대학원 경영학 석사 KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀 삼성증권 자금부 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 ☞주요운용펀드 : 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
박정환	2003-09-29	본부장 1964년	223	1,941,051	서울대학교 대학원 경영학과 (경영학 석사) 국민투자신탁 한국투신운용 現 마이다스에셋 자산운용 채권운용본부장 주요운용펀드: 마이다스퇴직연금채권모투자신탁	03-02002-0026
최영철	2008-10-08	팀장 1973년	23	1,461,741	서울대학교 계산통계학과 (경제학 부전공) Bain & Company Consultant 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 ☞주요운용펀드 : 마이다스베스트트리오증권투자신탁(주식)	08-02002-0046
이승준	2005-06-23	팀장 1973년	23	1,461,741	Columbia University Financial Math 신영증권 미래에셋자산운용 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 ☞주요운용펀드 : 마이다스액티브증권투자회사(주식)	06-02002-0034
오종록	2008-05-16	운용역 1973년	223	1,941,051	서울대학교 경제학과 교보투신 한누리투자증권 이트레이드증권 알리안츠생명보험 자산운용 現 마이다스에셋자산운용 채권운용본부 차장 ☞주요운용펀드 : 마이다스티지여객채권모투자신탁	05-02002-0028
송형섭	2006-04-28	운용역 1974년	223	1,941,051	서울대학교 경영대학교 석사 랜드마크자산운용 유리스투자자문 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 차장 ☞주요운용펀드 : 월드 In Best 주식 재간점 모투자신탁	06-02002-0033

) 가 : (5) (259,970)

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	13	0.12	12	0.12	
투자매매/중개업자	29	0.26	27	0.26	
신탁업자	1	0.01	1	0.01	
일반사무관리회사	1	0.01	1	0.01	
보수 합계	45	0.39	41	0.40	
기타비용**	2	0.01	2	0.02	
매매/중개수수료	6	0.05	4	0.04	

* 집합투자기구의 순자산총액 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적/반복적으로 지출된 비용으로서 매매/중개수수료는 제외한 것입니다.

▶ 총보수비용 비율

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.62	0.21	1.62	0.21
당기	1.67	0.17	1.67	0.17

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio) 이란 운용보수 등 집합투자기구에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균(보수,비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수,비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매/중개수수료 비율이란 매매/중개수수료를 순자산 연평균액(보수,비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매/중개수수료의 수준을 나타냅니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

(단위 : 주,원,%)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
37,482	1,426,830,800	44,008	1,598,779,580	58.12	233.11

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

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이더스 블루칩배당 30 증권 투자회사(채권혼합)의 집합투자업자인 마이더스에셋자산운용이 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 : 마이더스에셋자산운용 <http://www.midasasset.co.kr> / 02-3787-3500

금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>