

마이다스옵티멈장기증권저축투자회사

자 산 운 용 보 고 서

(운용기간 : 2010-10-22 ~ 2011-01-21)

가 가
가 가 (3) 가

마이다스에셋자산운용

서울 영등포구 여의도동 23-3 마이다스에셋자산운용
전화 02)3787-3500 <http://midasasset.com>

I. 기본정보

- 1. 개 요
- 2. 운용성과
- 3. 자산구성 현황

II. 상세정보

- 1. 상품의 개요
- 2. 자산보유 및 운용현황
- 3. 매매주식총수, 매매금액 및 매매회전율
- 4. 운용의 개요 및 손익현황
- 5. 운용전문인력 현황
- 6. 중개회사별 거래금액/수수료 및 그 비중
- 7. 이해관계인과의 거래에 관한 사항
- 8. 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사 여부 및 그 내용
- 9. 분배금 지급내역
- 10. 공지사항

<참고 : 펀드용어 정리>

1. 기본정보

1. 개요

가. 명 칭 마이다스옵티멈장기증권저축투자회사
 나. 자산운용협회펀드코드 33045
 다. 분 류 유추열(주식형)/개방형
 라. 운 용 기 간 3개월(2010-10-22 ~ 2011-01-21)
 마. 자산운용회사 마이다스에셋자산운용
 바. 적 용 법 률 간접투자자산운용업법(자본시장법 미전환)

간접투자재산 현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	2,435,611,866	2,474,607,594	1.60
부채 총액 (B)	32,765,865	55,300,009	68.77
순자산총액 (C=A-B)	2,402,846,001	2,419,307,585	0.69
발행 수익증권 총 좌수 (D)	2,222,754,688	2,175,706,821	-2.12
기준가격 (E=C/D*1000)	1,081.02	1,111.96	11.20

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

2. 운용성과

가. 기간 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
투자회사	2.81	11.20	18.58	19.62	20.87
비교지수	1.28	7.94	13.95	14.26	15.81

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

이 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

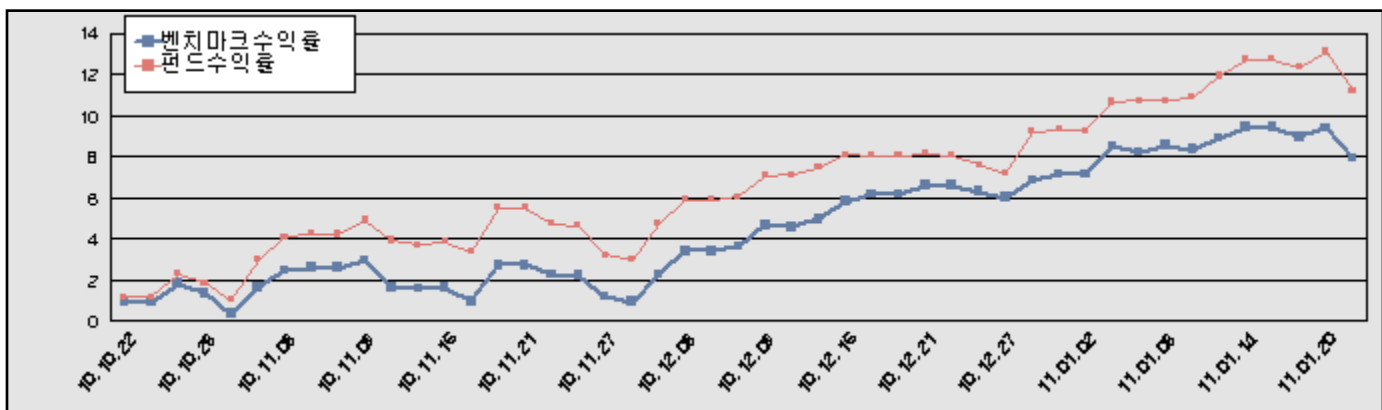
나. 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
투자회사	20.87	35.53	10.99	11.67
비교지수	15.81	27.89	7.01	8.66

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

이 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

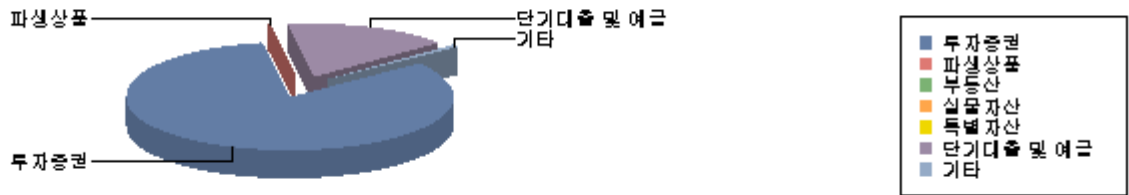


비교지수(Bench Mark) = KOSPI 75% + CD금리 25%

운용계획

1분기 주식시장은 미국 경제지표 호전에도 불구하고 지속적인 상승에 대한 부담과 중국 긴축 지속으로 단기적 횡보장세가 예상됩니다. 그러나 견조한 선진국 경제지표와 1분기 이후 중국 긴축 기조의 완화를 고려하면 횡보기간은 길지 않을 것으로 예상됩니다. 선진국으로의 자금이동으로 인해 외국인들의 매도가 나타나고 있으나 국내의 경우 환매 감소로 수급여건은 점차 개선될 것으로 예상됩니다. 선진국 경제 지표 호전의 수혜가 예상되는 IT업종과 금리 상승의 수혜가 예상되는 금융업종의 비중을 높여 대응할 계획이며 상승가능성이 점차 줄 것으로 예상되는 자동차 업종의 비중은 낮춰갈 계획입니다. 더불어 분기 후반에는 중국 긴축 리스크 감소가 예상되어 중국 관련 업종으로 비중을 확대할 예정입니다.

3. 자산구성 현황



(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투자 증권	특별 자산			
원화	2,051 (82.88)	0 (0.00)	0 (0.00)	2 (0.08)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	403 (16.27)	19 (0.78)	2,475 (100.00)
합계	2,051 (82.88)	0 (0.00)	0 (0.00)	2 (0.08)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	403 (16.27)	19 (0.78)	2,475 (100.00)

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

투자대상 상위 10종목

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
삼성전자	13.02	LG화학	4.99
하이닉스	4.82	기아차	4.77
하나금융지주	4.03	현대차	3.70
LG	3.60	우리금융	3.50
KB금융	3.33	현대중공업	3.00

산업별 투자비중

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
전기, 전자	21.90	운수장비	16.09
화학	14.06	금융업	10.86
서비스업	8.78	유통업	7.61
철강및금속	6.18	증권	3.93
보험	3.23	기타	7.36

II. 상세정보

1. 상품의 개요

설립일	2001-10-22	<i>자산운용협회펀드코드</i>	33045		추가형
자산운용회사(법인이사)	마이다스에셋자산운용		감독이사	나동민	김형진
등록일	2001-10-25	자산보관회사	국민은행	<i>일반사무관리회사</i>	SC펀드서비스
<i>판매회사</i>	현대증권 신한은행 교보증권				
상품의 특징	<p>본 상품은 주식 투자를 순자산총액의 95%이하 (연평균 주식보유비율이 70%이상 유지), 채권 및 유동성자산에의 투자를 순자산총액의 5%이상으로 투자하는 주식형 펀드입니다. 또한 파생상품 중에서 주가지수 콜옵선매도를 통하여 추가적인 투자수익 및 기초자산의 가격변동 위험의 부분적 감소를 추구하기에 다른 주식형 펀드와 비교하여 상대적으로 안정된 수익을 기대 할 수 있는 상품입니다. 한편 자산의 95%까지 주식에 투자되는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 있으며, 또한 커버드콜 전략에 의해서 안정된 초과수익을 실현하고 있으나 만기일과 만기일 사이에 급등을 하는 특정월에는 펀드수익률 상승이 제한되기도 합니다.</p>				

2. 자산보유 및 운용현황

- 주식

(단위 : 주, 원, %)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	275	267,025,000	13.02
LG화학	257	102,414,500	4.99
하이닉스	3,521	98,940,100	4.82
기아차	1,747	97,832,000	4.77
하나금융지주	1,805	82,669,000	4.03
현대차	409	75,869,500	3.70
LG	854	73,871,000	3.60
우리금융	4,640	71,688,000	3.50
KB금융	1,202	68,393,800	3.33
현대중공업	129	61,597,500	3.00
GS	804	59,656,800	2.91
LG디스플레이	1,540	57,442,000	2.80
현대모비스	199	56,416,500	2.75
POSCO	112	52,584,000	2.56
대우증권	1,745	48,249,250	2.35
대림산업	361	44,944,500	2.19
현대미포조선	170	38,335,000	1.87
SK이노베이션	210	38,325,000	1.87
대우인터내셔널	1,040	37,804,000	1.84
한진해운	1,011	37,407,000	1.82
삼성물산	450	35,100,000	1.71
코오롱인더	473	34,954,700	1.70
한화케미칼	938	34,424,600	1.68
동부화재	737	34,270,500	1.67
롯데쇼핑	80	34,200,000	1.67
두산중공업	421	33,848,400	1.65

(단위 : 주,원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
엔씨소프트	162	32,886,000	1.60
우리투자증권	1,437	32,332,500	1.58
현대해상	1,130	32,035,500	1.56
SKC	750	31,950,000	1.56
카프로	1,193	28,154,800	1.37
현대제철	222	28,083,000	1.37
현대그린푸드	2,439	25,853,400	1.26
삼성SDI	162	25,758,000	1.26
세아베스틸	564	24,957,000	1.22
LG상사	617	23,044,950	1.12
고려아연	69	21,114,000	1.03
동아제약	157	18,212,000	0.89
락앤락	519	18,113,100	0.88
대한항공	220	16,500,000	0.80
웅진코웨이	386	13,683,700	0.67
합계	35,157	2,050,940,600	100.00

※ 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 채권

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

※ 비중 : 채권 총액중 해당 종목이 차지하는 비중.

- 어음 및 채무증서

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

※ 어음 및 채무증서 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

- 장내파생상품

(단위 : 계약,원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 C 201102 290.0	매도	58	464,000	
합계		58	464,000	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						

- 실물자산

(단위 : 원)

종류	취득일자	취득가격	평가금액	비고
해당사항 없음				

- 특별자산

(단위 : 원,%)

종류	취득일자	취득가격	평가액	비고
해당사항 없음				

- 단기대출 및 예금

(단위 : 원,%)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 3일물 2.78	교보증권	2011-01-21	200,015,552	2.78	2011-01-24	
예금	국민은행		202,557,282			
합계			402,572,834			

- 기타

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
미수배당금	19,193,160	
합계	19,193,160	

- 유가증권 대여 및 차입

(단위 : 원,%)

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

3. 매매주식총수, 매매금액 및 매매회전을

(단위 : 주, 원,%)

매수		매도		3개월
수량	금액	수량	금액	
13,720	532,280,100	19,152	806,532,980	39.57

※ 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.

4. 운용의 개요 및 손익현황

- 운용성과

동 기간 동안 펀드 수익률은 11.20%를 기록하였고, 비교지수의 변동률은 7.94%를 기록하였습니다. 수익률이 비교지수 대비 양호했던 요인은 1) 4분기 상승폭이 컸던 IT, 화학, 금융 업종의 비중이 높았던 반면 유틸리티, 통신 등 수익률이 저조했던 업종의 펀드내 편입비중이 낮았으며 2) 구조적 성장과 실적 개선 기대감으로 편입한 기아차, 삼성전자, 세아베스틸 등의 주가 상승률이 동기간 높았던 점을 들 수 있습니다. 업종별로는 3분기까지 부진했던 IT 업종의 반등했으며 화학, 정유 업종은 전분기와 마찬가지로 수익률이 좋았습니다. 종목별로는 삼성전자, 기아차, 현대중공업, 대림산업 하나금융지주 등의 수익률이 양호했으며 효성, 고려아연, 엔씨소프트 등의 주가 수익률이 상대적으로 부진하였습니다.

- 손익현황

(단위 : 백만원,%)

구분	투자증권			파생상품		부동산	실물 자산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익 합계
	주식	채권	기타	장내	장외			간접투자증권	특별자산			
당기손익	259	0	0	-3	0	0	0	0	0	1	2	259
전기손익	140	0	0	24	0	0	0	0	0	1	-15	150

- 보수 지급 현황

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
자산운용회사 보수	4	0.18	4	0.18	
판매회사 보수	8	0.36	9	0.36	
수탁회사 보수	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사 보수	0	0.02	0	0.02	
보수 합계	13	0.57	14	0.57	

※ 투자신탁의 순자산총액 대비 비율

- 총보수,비용비율

(단위 : %)

구분	전기	당기
총보수,비용비율	3.00	3.07
매매수수료비율	0.16	0.22

※ 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 투자신탁에서 부담하는 ‘보수’와 투자신탁재산의 운용과정에서 경상적·반복적으로 발생하는 유가증권 매매수수료 등의 ‘기타비용’을 순자산총액으로 나눈 비율로서 해당 운용기간중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냄.

5. 운용전문인력 현황

(단위 : 개, 백만원)

성명	연령	직위	운용현황		주요 운용경력 및 이력	협회등록번호
			운용중인 다른 간접투자기구 수	다른 운용 자산 규모		
허필석	1967년	대표이사	7	431,105	서울대학교 대학원 경영학 석사, KAIST Techno MBA, CFA 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 ※주요운용펀드 : 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
채경섭	1974년	운용역	7	431,105	BASF Company, Ltd. 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장	2109000941

※ 성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모
허필석 : 없음
채경섭 : 없음

6. 중개회사별 거래금액/수수료 및 그 비중

■ 주식

(단위 : 백만원,%)

구분	11			12			1		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	85 (19.86)	0 (19.79)	0.10	201 (36.28)	0 (36.28)	0.10	141 (39.58)	0 (39.59)	0.10
	0 (0.00)	0 (0.00)		73 (13.19)	0 (13.19)	0.10	80 (22.43)	0 (22.43)	0.10
	150 (35.07)	0 (35.11)	0.10	280 (50.54)	0 (50.54)	0.10	116 (32.57)	0 (32.57)	0.10
	0 (0.00)	0 (0.00)		0 (0.00)	0 (0.00)		19 (5.41)	0 (5.41)	0.10
KB	193 (45.07)	0 (45.09)	0.10	0 (0.00)	0 (0.00)		0 (0.00)	0 (0.00)	

■ 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	11			12			1		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	4 (100.00)	0 (100.00)	0.30	6 (100.00)	0 (100.00)	0.30	2 (100.00)	0 (100.00)	0.30

7. 이해관계인과의 거래에 관한 사항

(단위 : 백만원)

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

8. 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사 여부 및 그 내용

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)				불행사사유
				찬성	반대	불행사	중립	

9. 분배금 지급내역

분배금 지급일	분배금 지급금액 (백만원)	분배후 수탁고 (좌수 기준)	기준가격		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
해당사항 없음					

10. 공지사항

자본시장과 금융투자업에 관련하여 보다 자세한 사항은 아래의 주소로 문의하거나, 해당 집합투자업자, 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

용 어	내 용
자산운용협회 펀드코드	상장주식의 경우 회사명 또는 코드번호 6자리를 활용하여 수익자들이 쉽게 공시사항을 조회 및 활용할 수 있는 것처럼 펀드 또한 자산운용협회가 부여하는 5자리의 고유 코드가 존재하며, 펀드명 뿐만 아니라 이러한 코드를 이용하여 펀드의 각종 정보에 대한 조회가 가능합니다.
주식형(간접투자기구)	약관(정관)상 주식에 간접투자재산의 60%이상을 투자하는 펀드입니다.
추가형(간접투자기구)	기 설정된 펀드에 추가 설정이 가능한 펀드입니다.
수익증권	증권거래법상 유가증권의 일종으로 자산운용회사가 일반 대중으로부터 자금을 모아 펀드를 만들 때 이 펀드에 투자한 투자자들에게 출자비용에 따라 나눠주는 권리증서를 말합니다. 투자신탁에 가입(매입)한다는 것은 이 수익증권을 산다는 의미입니다
보수	투자신탁의 운용 및 관리와 관련된 비용입니다. 다시 말해 재산을 운용 및 관리해준 대가로 고객이 지불하는 비용입니다. 이는 통상 연율로 표시되며, 신탁보수에는 운용보수, 판매보수, 수탁보수 등이 있습니다. 보수율은 상품마다 다르게 책정되는 것이 일반적입니다.
자산운용회사	투자자는 은행, 증권사, 보험사 등의 판매회사에서 펀드 계좌를 트고 펀드에 가입하지만 이렇게 투자자로부터 모집한 자금으로 실제 주식 등의 유가증권에 투자, 운용하는 회사는 자산운용회사입니다. 즉, 자산운용회사는 투자자로부터 자금을 모은 펀드의 위탁자가 되어 펀드의 운용을 연으로 하는 자로서 금감위의 허가를 받은 회사를 말합니다.
수탁회사	수탁회사란 펀드의 수탁자로서 펀드재산의 보관 및 관리를 영업으로 하는 회사를 말합니다. 현행 법은 자산운용회사가 투자자로부터 위탁받은 자산을 회사의 고유 재산과 분리하여 관리하도록 규정하고 있으며, 이에 따라 투자자의 투자자금은 수탁회사에 안전하게 보관·관리되고 있습니다.
일반사무관리회사	펀드의 위탁을 받아 펀드의 기준가 산정 등의 업무를 대행하는 회사를 말합니다.
판매회사	판매회사란 펀드의 판매, 환매 등을 주된 업무를 하는 회사를 말하며, 투자자가 펀드를 주로 매입하는 은행, 증권사, 보험사 등이 이러한 판매회사에 속합니다. 판매회사는 투자자보호를 위하여 판매와 관련된 주요 법령 및 판매행위준칙을 준수할 의무가 있습니다.
매매수수료비율	해당 운용기간 중 펀드에서 지출되는 유가증권 및 파생상품 등의 매매수수료 총액을 펀드의 순자산총액(보수·비용차감전 기준)으로 나눈 비율입니다. 매매수수료율이 높을 경우 거래비용이 증가하여 펀드에서 지출되는 비용이 증가합니다.
성과보수	현행 법은 불특정다수의 일반 투자자를 대상으로 판매하는 펀드(공모펀드)의 경우 자산운용회사가 펀드의 성과에 따라 추가적 보수(성과보수)를 수취하는 것을 금지하고 있습니다. 그러나 소수의 투자자를 대상으로 하는 사모펀드 혹은 투자일임계약의 경우 약관(계약)에 따라 성과보수의 수취가 가능합니다. 펀드매니저가 성과보수가 있는 사모펀드 혹은 투자일임계약과 성과보수가 없는 공모펀드를 함께 운용함에 따라 성과보수가 있는 펀드 등의 투자수익을 높이기 위해 더 많은 투자노력을 기울이는 등 이해상충발생소지가 발생할 가능성이 있습니다.