

자산운용보고서

마이다스절대수익안정형증권투자회사[채권혼합]

(운용기간 : 2011년03월16일 ~ 2011년06월15일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

마이다스에셋자산운용(주)

(전화 : 3787-3500)

목 차

- 1 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적)수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 5 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전을
 - ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이다스절대수익안정형증권투자회사[채권혼합]		3등급	39386
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 일반형	최초설정일	2003.12.02
운용기간	2011.03.16 ~ 2011.06.15	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용(주)	펀드재산보관회사	하나은행
판매회사	교보증권, 대우증권, 신한금융투자, 하나대투증권, 한국투자증권	일반사무관리회사	외환펀드서비스
상품의 특징			

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
절대수익안정형증권[채권혼합]	자산 총액 (A)	4,549	4,707	3.48
	부채 총액 (B)	31	21	-32.23
	순자산총액 (C=A-B)	4,519	4,687	3.72
	발행 수익증권 총 수 (D)	4,478	4,620	3.17
	기준가격 ^주 (E=C/D×1000)	1,009.12	1,014.46	0.53

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드수익률은 0.53%를 기록하였습니다. 주식포트폴리오의 경우 IT, 화학, 정유, 자동차의 비중이 상대적으로 높았던 반면 유틸리티, 통신, 금융, 내수 관련 업종의 비중을 낮게 유지하였습니다. 업종별로 성과가 좋았던 화학, 정유주의 편입비를 높게 유지한 점, 성과가 저조했던 유틸리티, 통신 업종을 낮은 편입비율로 유지한 점은 펀드 성과 제고에 긍정적인 영향을 미쳤습니다. 종목별로는 기아차, GS건설 한화케미칼, 화신 LG화학 등의 수익률이 양호하여 펀드 성과에 긍정적인 영향을 미쳤으며 OCI, OCI머테리얼즈, 두산인프라코어, 대우인터내셔널, 한진해운 등의 추가수익률이 부진하여 펀드 전체 성과에 부정적인 영향을 미쳤습니다. 기간 중 주요 공모주 투자로는 엘티에스, 완리인터내셔널, 리켄, 코오롱플라스틱, 엠케이트렌드 등이 있었습니다. 엘티에스, 완리인터내셔널은 손실이 발생하였으나 리켄, 코오롱플라스틱은 수익이 발생하였습니다. 향후 투자대상 선정시, 공모가의 적정 밸류에이션 여부와 실적호조 및 향후 성장성 등을 감안하여 선별 투자할 계획입니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

그리스 재정위기에 비롯된 유럽 크레딧리스크로 인해 주식시장은 1분기 말부터 하락세를 보이고 있습니다. 그리스 재정 위기 문제는 심각한 것으로 보이지만 최악의 시스템 리스크로 연결되지는 않을 것으로 판단됩니다. 더불어 미국이 QE3까지 이어지기는 힘들겠지만 미시적인 유동성 확대정책은 가능할 것으로 보여 급격한 유동성의 축소가 나타나지 않을 것으로 보입니다. 중국의 경기선행지수가 반전을 하였고 곧 미국 또한 반전할 것으로 기대되기 때문에 유럽 재정위기 문제가 매우 심각한 수준까지 가지 않은 한 경기모멘텀은 하반기 재차 살아날 것으로 예상됩니다. 선행지수 모멘텀을 감안 해 일시적으로 IT의 비중을 상승시킬 예정이며 내수주의 경우 비중을 축소할 예정입니다. 여전히 화학, 정유, 자동차의 비중은 높게 유지할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
절대수익안정형증권[채권혼합]	0.53	1.14	1.45	1.66
(비교지수 대비 성과)	(-2.64)	(-1.06)	(-4.55)	(-7.54)
비교지수(벤치마크)	3.17	2.21	5.99	9.20

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
절대수익안정형증권[채권혼합]	1.66	4.94	13.17	23.16
(비교지수 대비 성과)	(-7.54)	(-2.97)	(15.33)	(6.12)
비교지수(벤치마크)	9.20	7.92	-2.16	17.04

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

▶ 손익현황

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	-20	11	0	0	46	0	0	0	0	3	-13	27
당기	102	21	0	0	-89	0	0	0	0	3	-14	24

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	1,297	1,992	0	0	0	0	0	0	0	1,416	3	4,707
(0.00)	(27.56)	(42.31)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(30.08)	(0.06)	(100.00)
합계	1,297	1,992	0	0	0	0	0	0	0	1,416	3	4,707

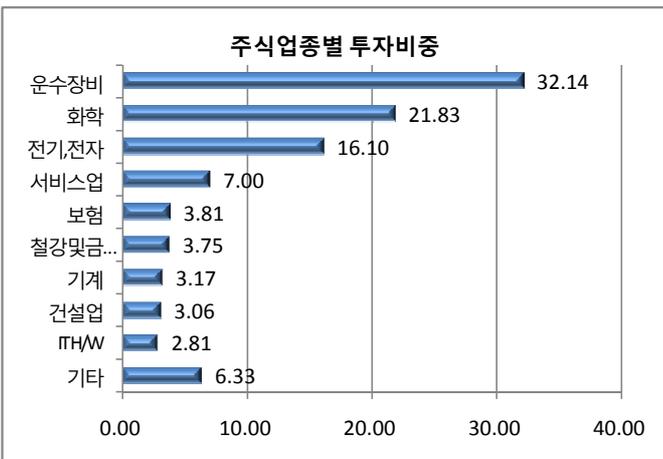
* () : 구성 비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

종목명	비중	종목명	비중
1 운수장비	32.14	6 철강및금속	3.75
2 화학	21.83	7 기계	3.17
3 전기,전자	16.10	8 건설업	3.06
4 서비스업	7.00	9 IT H/W	2.81
5 보험	3.81	10 기타	6.33



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	채권	국고채권0350-1406(11-2)	6	주식	현대차
2	파생상품	KOSPI200선물1109	7	주식	기아차
3	단기상품	보통예금(하나)	8	주식	현대중공업
4	단기상품	콜론(교보증권)	9	주식	삼성엔지니어링
5	주식	삼성전자	10	주식	대우조선해양

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 http://dis.kofia.or.kr) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

단위 : 주, 백만원, %

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	148	128	2.72	대한민국	KRW	전기,전자	
현대차	484	113	2.41	대한민국	KRW	운수장비	
기아차	1,441	104	2.22	대한민국	KRW	운수장비	
현대중공업	207	96	2.05	대한민국	KRW	운수장비	
삼성엔지니어링	231	59	1.27	대한민국	KRW	서비스업	
대우조선해양	1,240	58	1.24	대한민국	KRW	운수장비	

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고채권0350-1406(11-2)	2,000	1,991	대한민국	KRW	2011-06-10	2014-06-10		N/A	42.31

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 백만원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	비고
KOSPI200선물1109	매도	9	1,239	

주) 투자대상 상위 10종목 및 개별계약등의 위험평가액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 단기대출 및 예금

단위 : 주, 백만원, %

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
단기대출	교보증권	2011-06-15	400	3.30	2011-06-16	대한민국	KRW
예금	하나은행	2005-02-10	1,015	0.10		대한민국	KRW

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기	
		금액	비율	금액	비율
절대수익안정형증권[채권혼합]	자산운용사	5	0.11	5	0.11
	판매회사	6	0.13	6	0.13
	펀드재산물관리회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01
	일반사무관리회사	1	0.01	1	0.01
	보수합계	12	0.26	12	0.27
	기타비용**	1	0.03	1	0.03
	매매·중개수수료	2	0.04	2	0.04

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개수수료는 제외한 것임

※ 성과보수내역 : 없음

※ 발행분담금내역 : 없음

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
절대수익안정형증권[채권혼합]	전기	1.1884	0.1192	1.3076
	당기	1.1846	0.1347	1.3193

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

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

5. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
12,581	793	21,047	847	65.13	258.39

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

10년09월16일 ~10년12월15일	10년12월16일 ~11년03월15일	11년03월16일 ~11년06월15일
69.02	70.20	65.13

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스절대수익안정형증권투자회사[채권혼합]의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용(주)'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '하나은행'의 확인을 받아 판매회사인 '교보증권, 대우증권, 신한금융투자, 하나대투증권, 한국투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용(주)
금융투자협회

<http://www.midasasset.co>
<http://dis.kofia.or.kr>