

자 산 운 용 보 고 서

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

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

위험등급 : 2등급

펀드명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이다스옵티머스지배증권저축투자회사		33045	
펀드의 종류	투자회사/증권(주식형)/개방형	최초설정일	2001-10-22
운용기간	3개월(2011-01-22 ~ 2011-04-21)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	국민은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
판매회사	현대증권 신한은행 교보증권		
상품의 특징	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 콜옵션매도를 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.		

☞ 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	2,474,607,594	2,584,992,139	4.46
부채 총액	55,300,009	95,612,772	72.90
순자산총액	2,419,307,585	2,489,379,367	2.90
기준가격	1,111.96	1,180.00	6.12

) 가 가 (), () () 가

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드수익률은 6.12%를 기록하였으며, 비교지수의 변동률은 4.90%를 기록하여 비교지수 대비 1.22% 높은 수익률을 기록하였습니다. 주식포트폴리오의 경우 지난 분기동안양호한 흐름을 보인 자동차, 화학 등의 비중을 상대적으로 높게 유지하여 펀드 수익률에 긍정적인 영향을 미쳤습니다. 반면 상대적으로 저조한 흐름을 보인 통신, 유틸리티 등의 경기 방어 업종을 낮게 유지하였던 점 또한 펀드 수익률 제고에 도움이 되었습니다. 종목별로는 SK이노베이션, GS, LG화학, 엔씨소프트, 한화케미칼의 수익률이 양호하였으며 대한항공, 대우증권, 두산중공업, 한진해운 등의 수익률이 부진하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

지수가 역사적 신고점을 갱신하는 등 상승이 지속되고 있으나 미국의 QE2 종료 등 유동성 축소와 더불어 원자재 시장의 변동성이 높아지고 있습니다. 이러한 불안감으로 인해 증시 전반적으로 하락 또는 횡보장이 당분간 지속 될 것으로 예상되며 미국 등 각국 정부들의 정책적 변화와 원자재 시장의 변동에 민감하게 반응할 것으로 전망됩니다. 따라서2분기에는 향후 견조한 실적이 예상되는 IT업종에 대한 편입 비중을 지속 유지할 예정이며 기존 높은 성과를 보인 업종들에 대해서는 일부 차익실현을 할 예정입니다. 그러나 전반적으로 수급상황이 좋아질 것으로 예상하여 자동차, 화학 등 기존 주도주들의 하락 또는 횡보시점을 매수관점으로 판단하고 접근 할 예정입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
마이다스오팀장기증권저축투자회사	7.45	6.12	18.00	25.84	26.94
비교지수	7.31	4.90	13.24	19.54	19.87

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

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

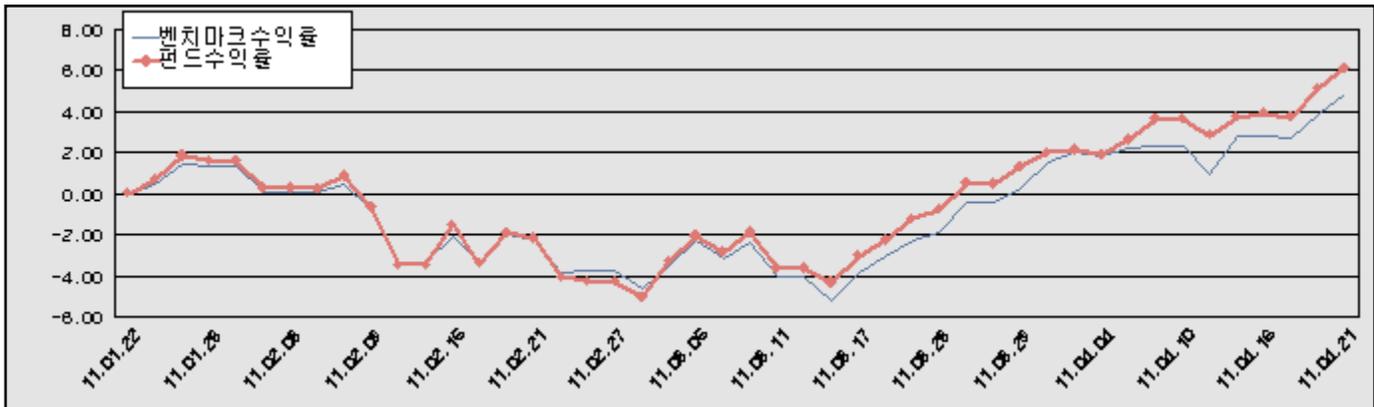
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이다스오팀장기증권저축투자회사	26.94	28.90	11.23	11.10
비교지수	19.87	21.66	6.75	8.14

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%

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

▶ 손익현황

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	206	-	-	-	-46	-	-	-	-	1	-14	147
전기손익	259	-	-	-	-3	-	-	-	-	1	2	259

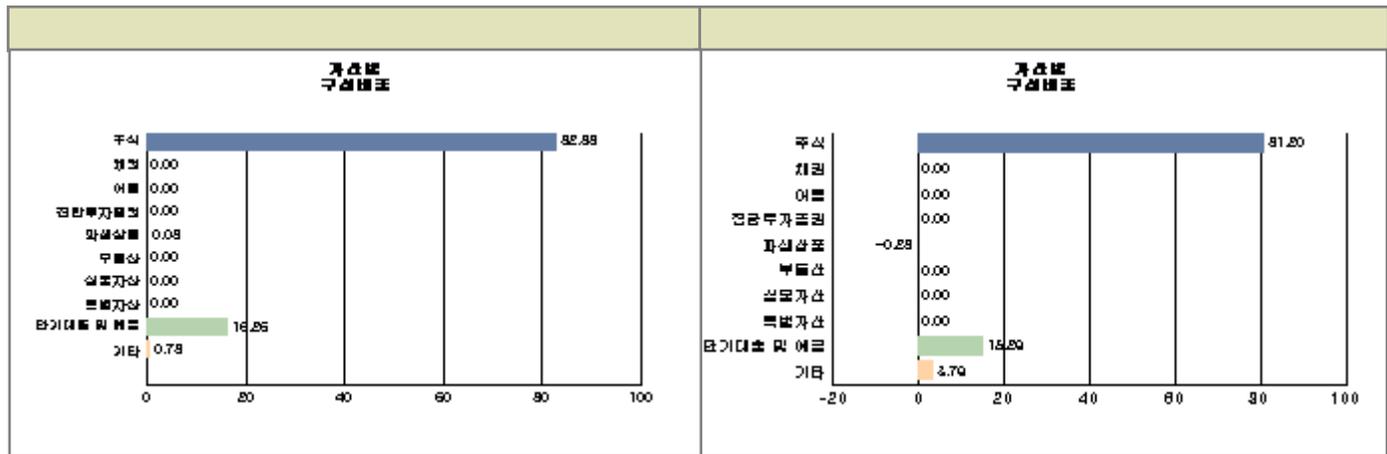
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	2,099 (81.20)	-	-	-	-7 (-0.28)	-	-	-	-	395 (15.29)	98 (3.79)	2,585 (100.00)
합계	2,099 (81.20)	-	-	-	-7 (-0.28)	-	-	-	-	395 (15.29)	98 (3.79)	2,585 (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	11.10	하이닉스	5.68
LG화학	5.65	기아차	5.34
현대중공업	4.10	현대차	3.99
한화케미칼	3.82	LG	3.46
GS	3.37	KB금융	3.26

업종별 투자비중

종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
전기, 전자	20.65	운수장비	17.19
화학	15.50	서비스업	9.25
금융업	8.57	철강및금속	6.55
유통업	6.51	보험	4.86
건설업	3.38	기타	7.54

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 C 201105 297.5	매도	57	11,400,000	
합계		57	11,400,000	0

) 가 5%

▶ 장외파생상품

▶ 부동산(임대)

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

▶ 특별자산

▶ 단기대출 및 예금

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
콜 1일물 3.05	교보증권	2011-04-21	200,016,712	3.05	2011-04-22	
예금	국민은행		195,251,930	0.10		

* 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위	운용중인 다른 펀드 현황		주요 경력 및 운용내역(최근5년)	협회등록번호
			펀드 수	운용 규모		
채경섭	2010-09-16	팀장 1974년	12	483,052	BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 ☞주요운용펀드: 마이다스신성장기업포커스증권투자신탁(주식)	2109000941
허필석	2001-10-26	대표이사 1967년	12	483,052	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 ☞주요운용펀드: 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011

) 가 가 (http://dis.kofia.or.kr)
 . 가 가 .
 . 가
 :
 :

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	4	0.18	4	0.17	
판매회사	9	0.36	8	0.34	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.02	0	0.01	
보수 합계	14	0.57	13	0.54	
기타비용**	1	0.05	1	0.05	
매매/중개수수료	1	0.06	1	0.05	

* 펀드의 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 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.45	0.24	2.45	0.24
당기	2.38	0.20	2.38	0.20

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 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
9,465	426,248,400	11,784	585,047,950	29.46	120.83

* 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율.

** 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

2010-07-22 ~ 2010-10-21	2010-10-22 ~ 2011-01-21	2011-01-22 ~ 2011-04-21
23.67	40.62	29.46