

자 산 운 용 보 고 서

공지사항

고객님이 가입하신 펀드는 『간접투자자산운용법에 관한 법률(자본시장법 미전환)』의 적용을 받습니다.

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 | |
|-------------------|--|-------------|------------|
| 마이다스플러스장기증권저축투자회사 | | 33105 | |
| 펀드의 종류 | 투자회사/증권(주식형)/개방형 | 최초설정일 | 2001-10-30 |
| 운용기간 | 3개월(2011-10-30 ~ 2012-01-29) | 존속기간 | 추가형 |
| 자산운용사 | 마이다스에셋자산운용 | | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 국민은행 | 일반사무관리회사 | SC펀드서비스 |
| 판매회사 | 하나대투증권 | | |
| 상품의 특징 | 본 상품은 간접투자자산운용법의 적용을 받는 회사형 간접투자기구로 투자자는 법률적으로 회사(펀드)의 주주가 됩니다. 본 상품은 주식 투자를 순자산총액의 95%이하(연평균 주식보유비율이 70%이상 유지), 채권 및 유동성자산에의 투자를 순자산총액의 5%이상으로 투자하므로 주식형 펀드로 분류할 수 있습니다. 또한 파생상품 중에서 주가지수 곱곱선거래를 통하여 추가적인 투자수익 및 기초자산의 가격변동 위험의 부분적 감소를 추구하기에 다른 주식형 펀드와 비교하여 상대적으로 안정된 수익을 기대 할 수 있는 상품입니다. 하지만 자산의 95%까지 주식에 투자되는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 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 |
|-------|---------------|---------------|-------|
| 자산 총액 | 2,143,548,225 | 2,002,835,797 | -6.56 |
| 부채 총액 | 27,535,144 | 44,410,532 | 61.29 |
| 순자산총액 | 2,116,013,081 | 1,958,425,265 | -7.45 |
| 기준가격 | 984.72 | 997.59 | 1.31 |

) 가 가 (), () () 가

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드수익률은 1.31%를 기록하였으며 벤치마크의 성과는 1.75%를 기록하였습니다. 주식포트폴리오의 경우 전분기와 마찬가지로 경기 방어업종의 비중을 소폭 상승시켰습니다. 유틸리티, 음식료의 비중을 상승시켰으며 반면 IT의 비중을 소폭 하락시켰습니다. 종목별로는 삼성전자, 대림산업, 호남석유, 고려아연 등의 수익률이 양호하였으며, 현대모비스, 엔씨소프트, 다음 등의 수익률이 부진하였습니다. 전반적으로 경기방어업종 비중을 지속적으로 높였으나 유동성 랠리로 인한 경기민감주 업종의 상승을 놓쳤던 것이 수익률 부진의 원인인 것으로 판단됩니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

유럽의 크레딧리스크가 소강상태를 보임에 따라 시장은 다소 진정되는 모습이 나타났습니다. 이에 따른 시장의 변동성 축소와 안정적인 박스권 주가 흐름이 나타났습니다. 그러나 여전히 유럽 리스크의 해결을 확실하기는 힘든 상황이며 미국 경제지표 또한 더 이상 예상치를 뛰어넘는 수치들이 나오지 못하고 있습니다. 2월 OECD 경기선행지수가 바텀 아웃할 것으로 예상됨에 따라 주식시장의 기대감이 높아질 것으로 보이지만 여전히 불안요인들이 있어 경기민감주들로의 변경은 다소 이른 것으로 판단됩니다. 전분기와 마찬가지로 중립적인 관점에서 접근할 예정입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1개월 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 1년 |
|-------------------|--------|--------|--------|--------|--------|
| 마이더스플러스장기증권저축투자회사 | 4.48 | 1.31 | -10.47 | -13.65 | -10.66 |
| 비교지수 | 5.76 | 1.75 | -5.07 | -6.73 | -3.68 |

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

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

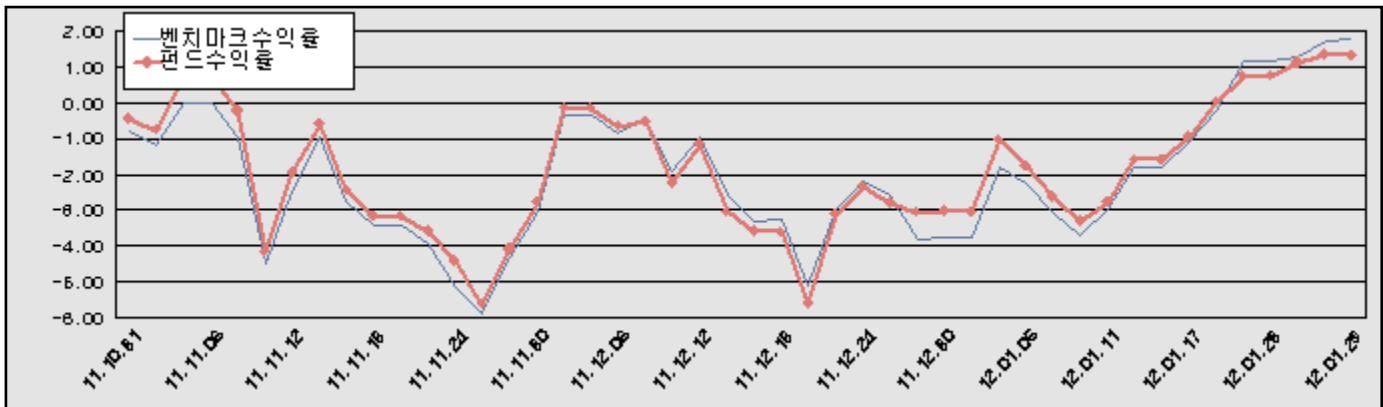
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|-------------------|--------|-------|-------|-------|
| 마이더스플러스장기증권저축투자회사 | -10.66 | 7.98 | 16.58 | 8.99 |
| 비교지수 | -3.68 | 9.24 | 15.26 | 7.38 |

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

(단위 : 백만원)

| 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출 및 예금 | 기타 | 손익합계 |
|------|------|----|----|--------|------|----|-----|------|----|-----------|----|------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자증권 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| 당기손익 | -1 | - | - | - | 14 | - | - | - | - | 1 | 5 | 19 |
| 전기손익 | -354 | - | - | - | 27 | - | - | - | - | -4 | 29 | -302 |

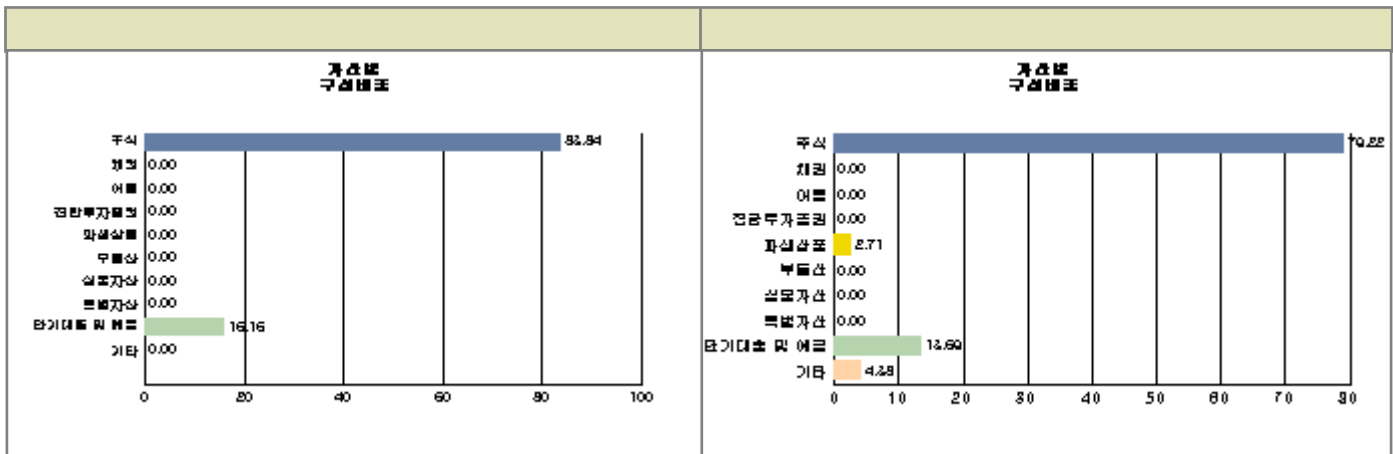
3. 자산현황

▶ 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 | 1,587 (79.22) | - | - | - | 54 (2.71) | - | - | - | - | 274 (13.69) | 88 (4.38) | 2,003 (100.00) |
| 합계 | 1,587 (79.22) | - | - | - | 54 (2.71) | - | - | - | - | 274 (13.69) | 88 (4.38) | 2,003 (100.00) |

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



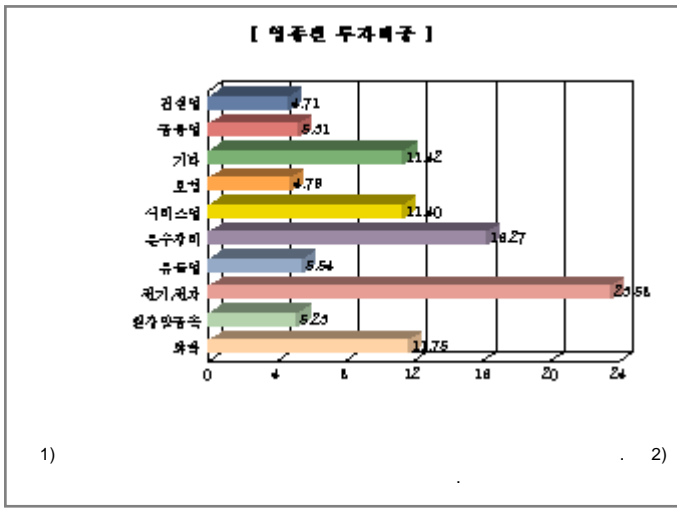
▶ 업종별, 국가별 투자비중

주식투자 상위 10종목

| 종 목 | 비 중 (%) | 종 목 | 비 중 (%) |
|------|---------|-------|---------|
| 삼성전자 | 14.68 | 현대차 | 6.18 |
| LG화학 | 4.29 | 기아차 | 4.00 |
| 하이닉스 | 3.75 | LG전자 | 2.91 |
| 삼성화재 | 2.87 | 현대모비스 | 2.81 |
| 한국전력 | 2.25 | 삼성SDI | 2.25 |

업종별 투자비중

| 종 목 | 비 중 (%) | 종 목 | 비 중 (%) |
|--------|---------|------|---------|
| 전기, 전자 | 23.58 | 운수장비 | 16.27 |
| 화학 | 11.75 | 서비스업 | 11.40 |
| 유통업 | 5.54 | 금융업 | 5.31 |
| 철강및금속 | 5.23 | 보험 | 4.79 |
| 건설업 | 4.71 | 기타 | 11.42 |



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|---------|------------|-------|-----|---------|------|------|
| 1 | 주식 | 삼성전자 | 11.63 | 2 | 단기대출및예금 | 예금 | 8.69 |
| 3 | 단기대출및예금 | 콜 3일물 3.30 | 4.99 | 4 | 주식 | 현대차 | 4.90 |
| 5 | 파생상품 | 증거금 | 3.72 | 6 | 주식 | LG화학 | 3.39 |
| 7 | 주식 | 기아차 | 3.17 | 8 | 주식 | 하이닉스 | 2.97 |
| 9 | 주식 | LG전자 | 2.30 | 10 | 주식 | 삼성화재 | 2.28 |

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

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

(단위 : 주,원,%)

| 종목 | 보유수량 | 평가금액 | 비중 |
|------|-------|-------------|-------|
| 삼성전자 | 207 | 232,875,000 | 14.68 |
| 현대차 | 444 | 98,124,000 | 6.18 |
| LG화학 | 178 | 67,996,000 | 4.29 |
| 기아차 | 947 | 63,543,700 | 4.00 |
| 하이닉스 | 2,286 | 59,436,000 | 3.75 |

※ 비중 : 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

▶ 어음

▶ 집합투자증권

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 원)

| 종목명 | 매수/매도 | 계약수 | 미결제약정금액 | 위탁증거금 |
|-----------------------|-------|-----|------------|------------|
| 코스피200 C 201202 257.5 | 매도 | 50 | 25,500,000 | |
| 합계 | | 50 | 25,500,000 | 74,490,885 |

) 가 5%

▶ 장외파생상품

▶ 부동산(임대)

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

▶ 특별자산

▶ 단기대출 및 예금

| 종류 | 금융기관 | 대출(예금)일자 | 대출(예금)액 | 적용금리 | 만기일 | 비고 |
|------------|------|------------|-------------|------|------------|----|
| 예금 | 국민은행 | | 174,109,526 | 0.10 | | |
| 콜 3일물 3.30 | 교보증권 | 2012-01-27 | 100,027,123 | 3.30 | 2012-01-30 | |

* 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 | | |
| 허필석 | 2001-11-06 | 대표이사 1967년 | 3 | 271,949 | 서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 ☞ 주요운용펀드: 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식) | 00-02002-0011 |
| 채경성 | 2010-09-16 | 팀장 1974년 | 3 | 271,949 | BASF Company, Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 ☞ 주요운용펀드: 마이다스신성장기업포커스증권투자신탁(주식) | 2109000941 |

)
:
:
:

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원,%)

| 구분 | 전기 | | 당기 | | 비고 |
|--------------|----|------|----|--------|----|
| | 금액 | (%)* | 금액 | 비율(%)* | |
| 자산운용사 | 3 | 0.13 | 3 | 0.13 | |
| 판매회사 | 7 | 0.36 | 7 | 0.36 | |
| 펀드재산보관(신탁업자) | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 | |
| 일반사무관리회사 | 0 | 0.02 | 0 | 0.02 | |
| 보수 합계 | 11 | 0.51 | 10 | 0.51 | |
| 기타비용** | 2 | 0.09 | 1 | 0.06 | |
| 매매/중개수수료 | 1 | 0.04 | 2 | 0.08 | |

* 펀드의 순자산평잔 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 | 2.38 | 0.18 | 2.38 | 0.18 |
| 당기 | 2.26 | 0.31 | 2.26 | 0.31 |

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔(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.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위 : 주, 원, %)

| 매수 | | 매도 | | 매매회전율 | |
|-------|-------------|--------|-------------|-------|--------|
| 수량 | 금액 | 수량 | 금액 | 3개월 | 연환산 |
| 8,745 | 503,695,250 | 14,986 | 717,161,000 | 42.72 | 171.35 |

* 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 : %)

| | | |
|-------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 2011-10-30 ~ 2012-01-29 | 2011-07-30 ~ 2011-10-29 | 2011-04-30 ~ 2011-07-29 |
| 42.72 | 27.88 | 54.20 |