

자 산 운 용 보 고 서

공지사항

고객님이 가입하신 펀드는 『간접투자자산운용업에 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	
마이다스옵티멈장기증권저축투자회사		33045	
펀드의 종류	투자회사/증권(주식형)/개방형	최초설정일	2001-10-22
운용기간	3개월(2012-07-22 ~ 2012-10-21)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	국민은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
판매회사	현대증권 신한은행 교보증권		
상품의 특징	본 상품은 주식 투자를 순자산총액의 95%이상, 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	1,276,360,228	1,018,680,057	-20.19
부채 총액	10,917,319	9,102,129	-16.63
순자산총액	1,265,442,909	1,009,577,928	-20.22
기준가격	929.19	958.61	3.17

) 가 가 (), () () 가

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 분기 펀드의 수익률은 3.17%로 벤치마크 대비 2.03% 낮은 성과를 기록하였습니다. 펀드가 저조한 수익을 기록한 원인은 이번 분기 말에 저조한 상승률을 보인 화학, 조선, 기계 등 경기민감주의 비중이 높았고, 최근 하락세를 보이고 있는 자동차 관련 주에 대한 비중도 상대적으로 높았기 때문입니다. 더불어 선물 부분에서 큰 폭의 손실이 발생한 점도 펀드가 낮은 성과를 기록하는 주 요인이었습니다. 종목별로는 대상, LG디스플레이, LG전자, 롯데쇼핑 등의 수익률이 양호하였으며 기아차, 두산중공업, 다음, NHN 등의 수익률이 부진하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

4분기 주식시장은 한국, 미국, 중국이 정권 교체를 앞두고 있는 상황으로 새로운 정책에 대한 기대감과 상대적으로 부진한 기업실적이 서로 상쇄되어 주식 시장의 박스권의 흐름을 이어갈 것이라고 판단됩니다. 3분기에는 중소형주가 강세를 나타냈고, 4분기에도 이러한 추세가 지속될 것으로 보입니다. 그러나 미국의 재정절벽(정부의 지출이 갑작스럽게 줄어들어 경제에 충격을 주는 현상) 등 시장에 충격을 줄 수 있는 이슈가 있을 것으로 판단되어 점차 변동폭이 큰 중소형주의 비중을 축소하고, 상대적으로 주가가 낮은 대형주의 편입 비율을 높일 필요가 있다고 판단됩니다. 전체적인 종목의 비중과 업종의 비중은 점차 시장의 비중과 유사한 상태로 변경할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일
마이다스옵티머스증권저축투자회사	-2.35	3.17	-4.66	-4.24	-0.83	-4.14	9.69	3.63	227.29
비교지수	-2.13	5.20	-0.62	0.58	5.53	5.41	16.86	6.92	210.08

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

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

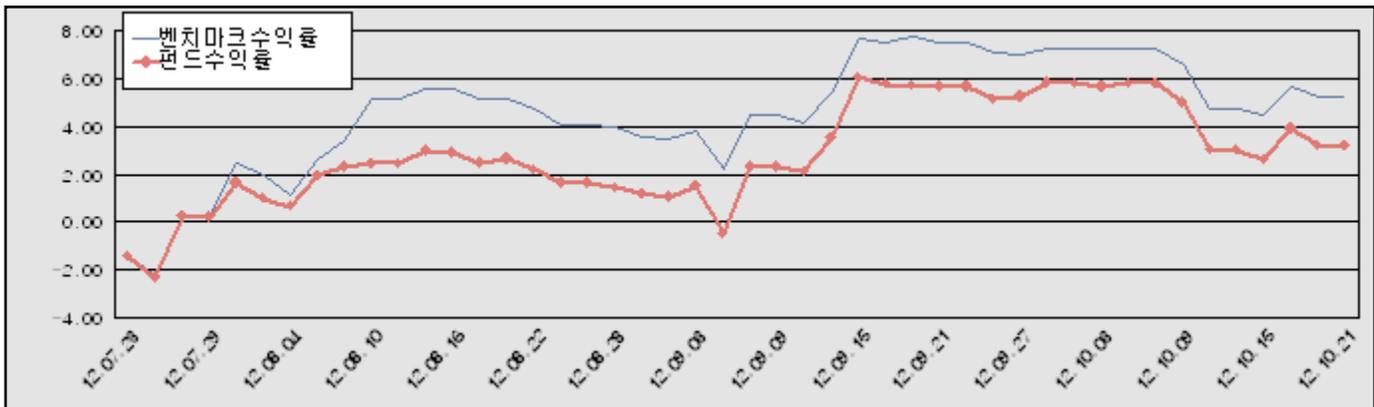
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이다스옵티머스증권저축투자회사	-0.83	-2.09	3.13	0.72
비교지수	5.53	2.67	5.33	1.35

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	48	-	-	-	-18	-	-	-	-	-2	16	44
전기손익	-443	-	-	-	44	-	-	-	-	-2	11	-390

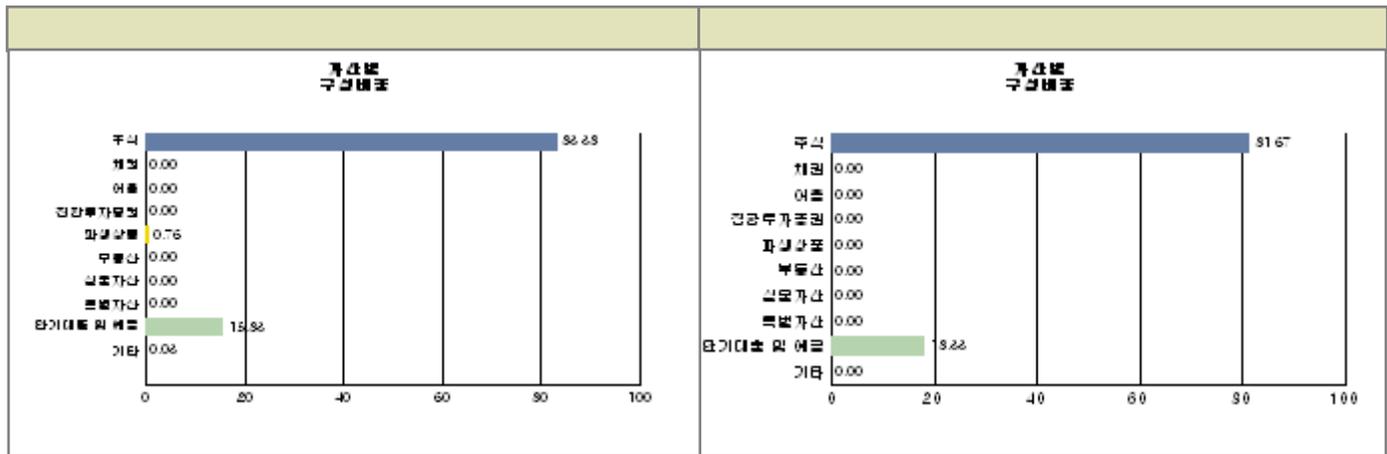
3. 자산현황

▶ 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	832 (81.67)	-	-	-	-	-	-	-	-	187 (18.33)	-	1,019 (100.00)
합계	832 (81.67)	-	-	-	-	-	-	-	-	187 (18.33)	-	1,019 (100.00)

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



▶ 업종별, 국가별 투자비중

주식투자 상위 10종목

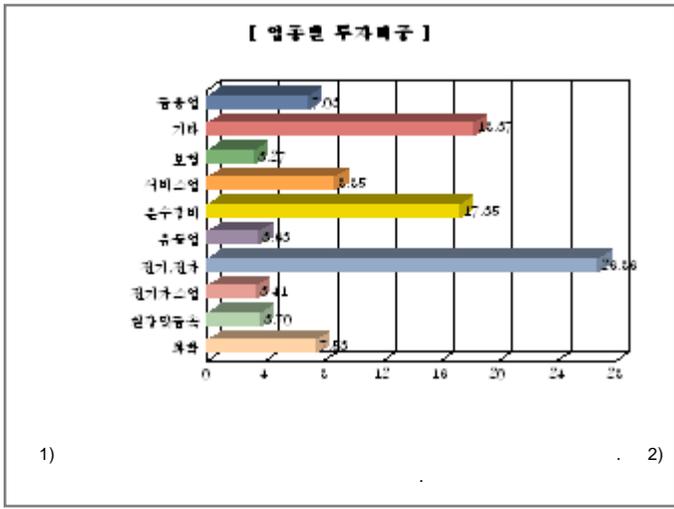
종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
삼성전자	18.00	현대차	6.19
SK하이닉스	3.75	LG화학	3.32
SK이노베이션	3.19	LG전자	3.13
기아차	3.11	SK텔레콤	2.47
한국전력	2.46	현대모비스	2.39

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

업종별 투자비중

종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
전기, 전자	26.86	운수장비	17.35
서비스업	8.85	화학	7.53
금융업	7.03	철강및금속	3.70
유통업	3.63	전기가스업	3.41
보험	3.27	기타	18.37

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중	
1	단기대출및예금	18.33	2	주식	삼성전자	14.70
3	주식	5.06	4	주식	SK하이닉스	3.06
5	주식	2.71	6	주식	SK이노베이션	2.61
7	주식	2.55	8	주식	기아차	2.54
9	주식	2.01	10	주식	한국전력	2.01

* 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

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

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

(단위 : 주,원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	115	149,730,000	18.00
현대차	226	51,528,000	6.19
SK하이닉스	1,338	31,175,400	3.75
LG화학	83	27,597,500	3.32
SK이노베이션	161	26,565,000	3.19

* 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

▶ 어음

▶ 집합투자증권

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 C 201211 265.0	매도	7	2,625,000	
합계		7	2,625,000	0

) 가 5%

▶ 장외파생상품

▶ 부동산(임대)

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

▶ 특별자산

▶ 유동성

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	국민은행		186,760,807	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		
허필석	2001-10-26	대표이사	7	290,613	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 ☞ 주요운용펀드 : 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	2109000325
채경섭	2001-10-26	팀장	2	11,216	BASF Company.Ltd., 신영증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 ☞ 주요운용펀드: 마이다스신성장기업포커스증권투자신탁(주)	2109000941

)
가
:
:

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	12	0.72	2	0.18	
판매회사	20	1.23	3	0.27	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.03	0	0.01	
일반사무관리회사	1	0.06	0	0.02	
보수 합계	33	2.05	5	0.47	
기타비용**	6	0.39	1	0.12	
매매/중개수수료	4	0.24	1	0.10	
증권거래세	6	0.36	2	0.15	

* 펀드의 순자산평잔 대비 비율

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

▶ 총보수비용 비율

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율	합성 총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율
전기	2.43	0.24	2.43	0.24
당기	2.35	0.38	2.35	0.38

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
5,816	261,468,950	11,587	572,156,100	59.05	236.83

※ 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 매매회전을 추이

(단위 : %)

2012-07-22 ~ 2012-10-21	2011-07-22 ~ 2012-07-21	2010-07-22 ~ 2011-07-21
59.05	146.70	140.98