

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(2012-10-22 ~ 2013-01-21)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	국민은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
판매회사	현대증권 신한은행 교보증권		
상품의 특징	본 상품은 주식에 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	1,019,605,057	993,650,961	-2.55
부채 총액	10,027,129	6,647,547	-33.70
순자산총액	1,009,577,928	987,003,414	-2.24
기준가격	958.61	983.88	2.64

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.

주) 위 전기말 기준가격은 결산부기준가격이며, 재투자기준가격은 펀드(958.61)입니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 분기 펀드의 수익률은 2.64%로 비교지수 대비 0.77% 좋은 성과를 기록하였습니다. 동 펀드가 상대적으로 좋은 성과를 거둔 것은 제약 및 전기전자 업종 등 지난 분기 강세를 보였던 업종들에 대해 선제적으로 비중을 확대해 둔 전략이 주효하였기 때문입니다. 개별 종목별로는 한미약품, 종근당, 동아제약, 하나금융지주, 한국전력 등의 주가가 동기간 양호하였던 반면, 켈투스, 에스엠, 게임빌, 파라다이스, 현대위아, KT&G 등의 수익률은 상대적으로 부진하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

2013년 1분기 초 주식시장은 원화강세 및 상장기업의 저조한 4분기 실적으로 인하여 조정이 예상됩니다. 그러나 분기 말로 가면 불확실성의 해소 및 중국 경기의 반등으로 인하여 주식 시장에는 완전한 상승흐름이 나타날 것으로 보입니다. 특히 중국 경제의 경우 지난 3분기를 저점으로 경기가 개선 추세에 진입한 것으로 판단되어, 향후 우리 증시는 이러한 흐름에 편승해 상승흐름을 탈 수 있을 것으로 보입니다. 이에 따라 주식시장이 조정흐름을 보일 때마다 주식의 펀드 내 편입 비중을 확대할 계획이며, 대형주는 박스권 매매, 중소형주는 신규 발굴을 통해서 초과수익을 창출하는 원칙을 지켜나갈 것입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년	설정일
마이다스옵티머스지증권저축투자회사	1.82	2.64	5.89	-2.14	-1.71	-11.52	6.95	20.97	235.92
비교지수	0.31	1.87	7.17	1.23	2.46	-0.53	15.20	21.90	215.87

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

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

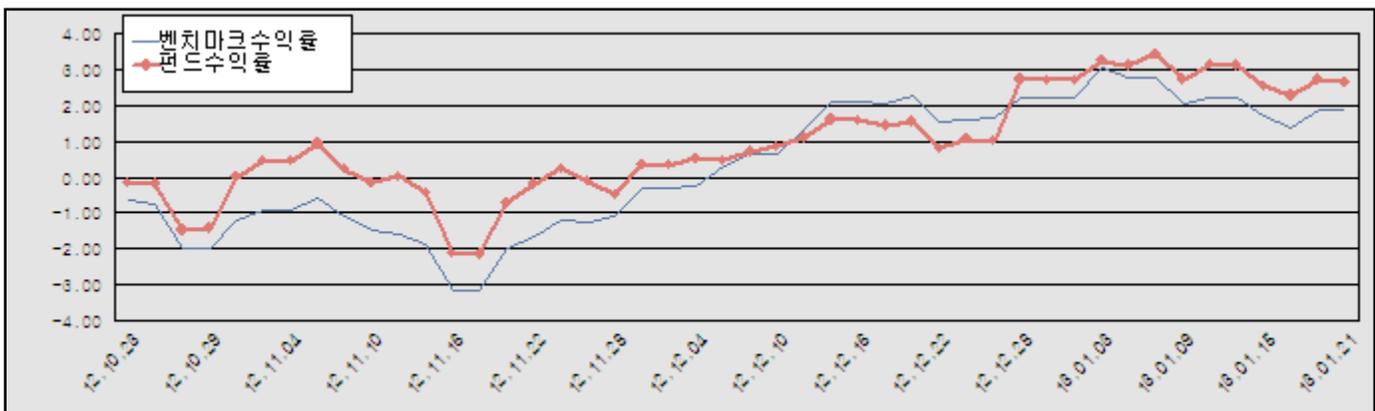
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이다스옵티머스지증권저축투자회사	-1.71	-5.94	2.26	3.88
비교지수	2.46	-0.26	4.83	4.04

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	22	-	-	-	3	-	-	-	-	0	0	25
전기손익	77	-	-	-	-26	-	-	-	-	0	-9	42

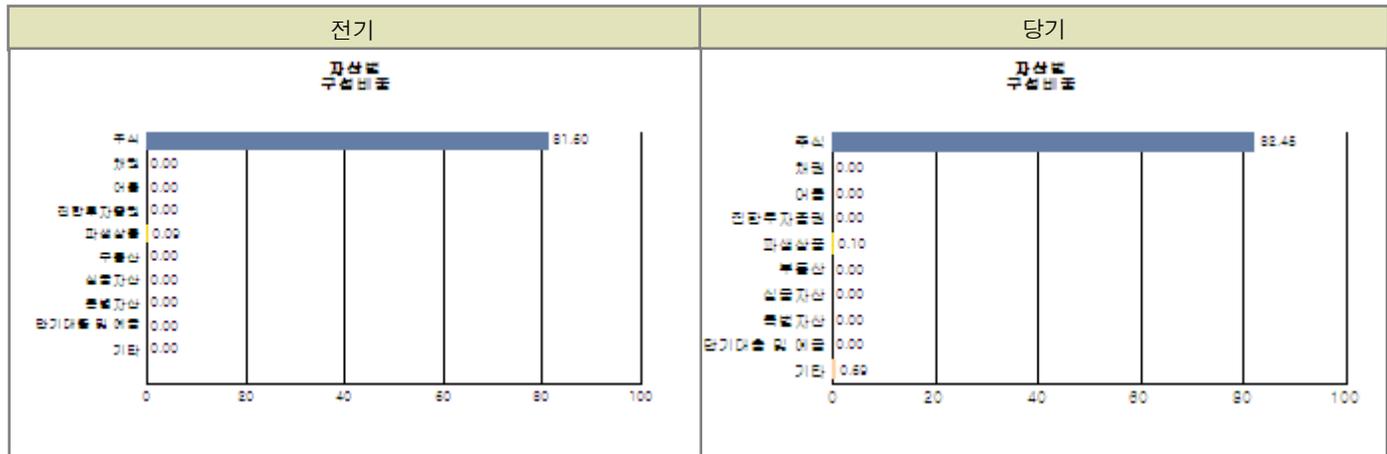
3. 자산현황

▶ 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	819 (82.45)	-	-	-	1 (0.10)	-	-	-	-	-	7 (0.69)	827 (83.24)
합계	819 (82.45)	-	-	-	1 (0.10)	-	-	-	-	-	7 (0.69)	827 (83.24)

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



▶ 업종별, 국가별 투자비중

주식투자 상위 10종목

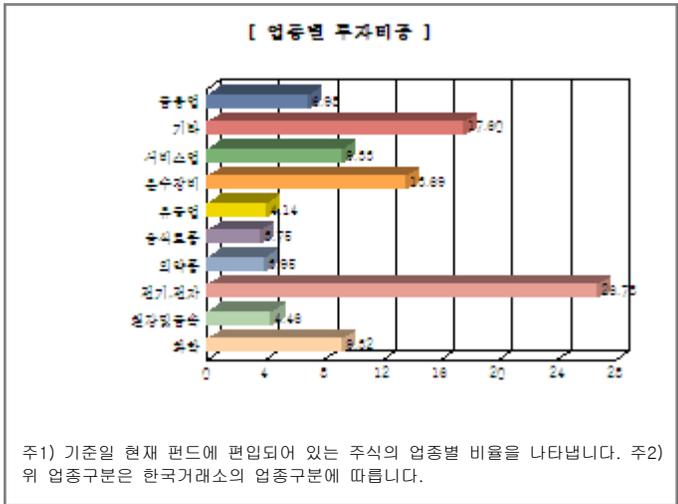
종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
삼성전자	17.39	현대차	6.06
SK하이닉스	3.89	SK이노베이션	3.11
LG전자	3.02	SK텔레콤	2.72
POSCO	2.67	LG화학	2.62
NHN	2.43	현대중공업	2.42

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

업종별 투자비중

종 목	비 중 (%)	종 목	비 중 (%)
전기, 전자	26.78	운수장비	13.69
서비스업	9.33	화학	9.32
금융업	6.98	철강및금속	4.46
유통업	4.14	의약품	3.95
음식료품	3.75	기타	17.60

※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	14.34	2	주식	현대차	5.00
3	주식	SK하이닉스	3.21	4	주식	SK이노베이션	2.57
5	주식	LG전자	2.49	6	주식	SK텔레콤	2.25
7	주식	POSCO	2.20	8	주식	LG화학	2.16
9	주식	NHN	2.01	10	주식	현대중공업	1.99

* 비중 : 펀드내 순자산 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

* 보다 상세한 투자대상자산 내역은 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

■ 상위 5개 종목

(단위 : 주,원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	98	142,492,000	17.39
현대차	236	49,678,000	6.06
SK하이닉스	1,238	31,878,500	3.89
SK이노베이션	151	25,519,000	3.11
LG전자	324	24,721,200	3.02

* 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

해당사항 없음

▶ 어음

해당사항 없음

▶ 집합투자증권

해당사항 없음

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
코스피200 C 201302 277.5	매도	6	600,000	
합계		6	600,000	0

주) 개별계약 등의 위험평가액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 장외파생상품

해당사항 없음

▶ 부동산(임대)

해당사항 없음

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

해당사항 없음

▶ 특별자산

해당사항 없음

▶ 기타

해당사항 없음

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	287,020	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 ☞ 주요운용펀드 : 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	2109000325
채경섭	2001-10-26	팀장	2	10,152	BASF Company.Ltd., 신용증권, 흥국투자신탁, KB자산운용, 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 팀장 ☞ 주요운용펀드: 마이다스신성장기업포커스증권투자신탁(주)	2109000941

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

※ 성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모

허필석 : 없음

채경섭 : 없음

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	2	0.18	2	0.18	
판매회사	3	0.27	3	0.27	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.02	0	0.02	
보수 합계	5	0.47	5	0.48	
기타비용**	1	0.12	1	0.12	
매매/중개수수료	1	0.10	0	0.04	
증권거래세	2	0.15	1	0.05	

* 펀드의 순자산평잔 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예탁 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	2.35	0.38	2.35	0.38
당기	2.38	0.15	2.38	0.15

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
1,921	141,923,300	2,527	177,009,300	21.48	86.14

※ 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 : %)

2012-10-22 ~ 2013-01-21	2012-07-22 ~ 2012-10-21	2012-04-22 ~ 2012-07-21
21.48	59.05	4.63