

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, 쉐어, 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 |
|--------------------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 마이다스옵티머스지주증권저축투자회사 | 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.

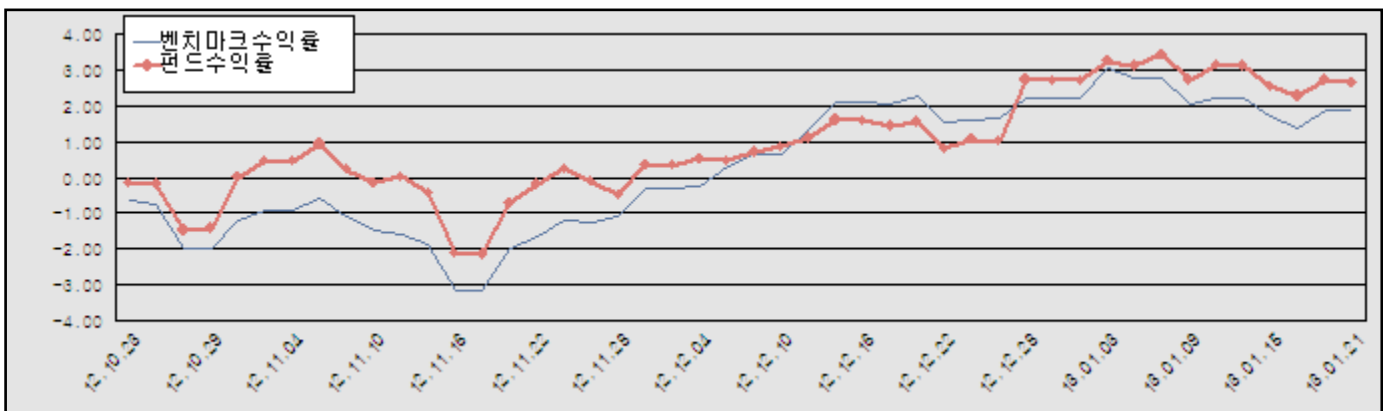
▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|--------------------|-------|-------|-------|-------|
| 마이다스옵티머스지주증권저축투자회사 | -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 |

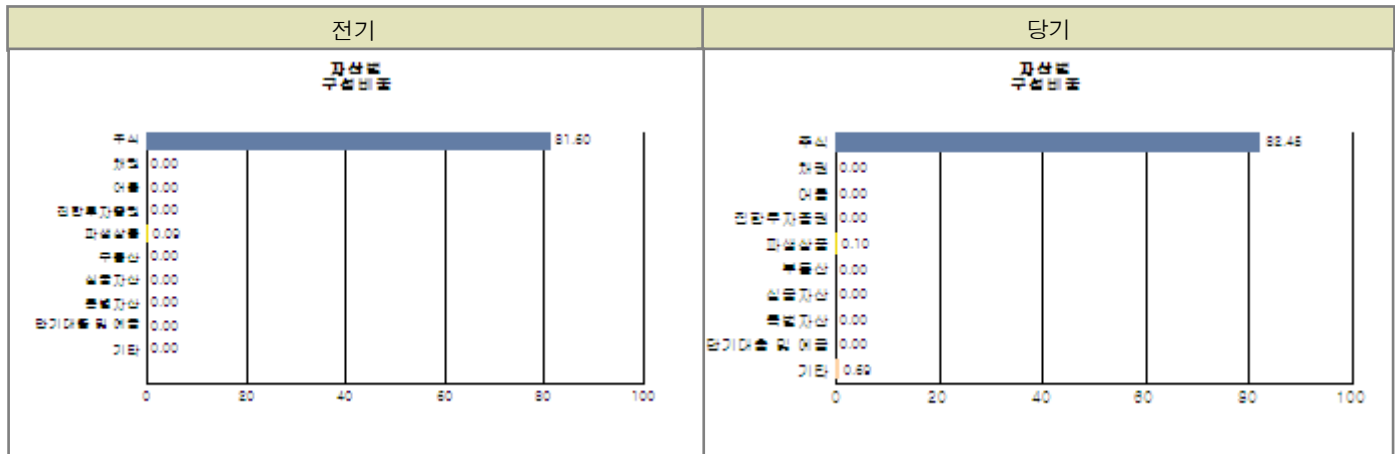
3. 자산현황

▶ 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 |

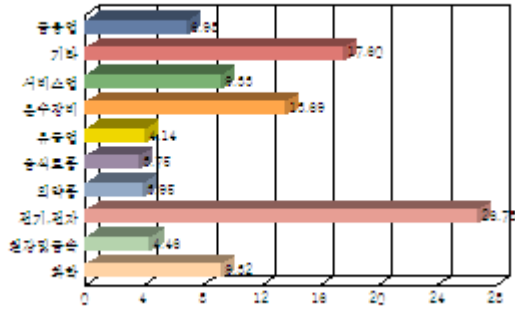
※ 비중 : 펀드내 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

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

[업종별 투자비중]



주1) 기준일 현재 펀드에 편입되어 있는 주식의 업종별 비율을 나타냅니다. 주2) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분에 따릅니다.

▶ 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 |