

자산운용보고서

마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)운용

(운용기간 : 2016년02월24일 ~ 2016년05월23일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며,
.투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다

마이다스에셋자산운용

서울시 영등포구 여의대로 66 KTB증권빌딩 8층
(전화 02-3787-3500, <http://www.midasasset.com>)

목 차

- 1 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 자산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적)수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 환헤지에 관한 사항
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 투자운용인력
 - ▶ 운용전문인력 최근 변경 내역
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용), 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)A, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)Ae, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-P2, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-W, 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)Ce		3등급	AX668, AX669, AX670, AX671, B8572, BB697, AX672
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형	최초설정일	2014.11.24
운용기간	2016.02.24 ~ 2016.05.23	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	기업은행, 신한은행, 우리은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징			

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
단기국공채공모주1(채혼)(운용)	자산 총액 (A)	87,863	139,143	58.36
	부채 총액 (B)	6,059	482	-92.04
	순자산총액 (C=A-B)	81,804	138,661	69.50
	발행 수익증권 총 수 (D)	77,282	130,749	69.18
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,058.51	1,060.51	0.19
종류(Class)별 기준가격 현황				
단기국공채공모주1(채혼)A	기준가격	1,008.19	1,008.38	0.02
단기국공채공모주1(채혼)Ae	기준가격	1,008.64	1,009.29	0.06
단기국공채공모주1(채혼)C	기준가격	1,007.56	1,007.13	-0.04
단기국공채공모주1(채혼)Ce	기준가격	1,008.31	1,008.63	0.03
단기국공채공모주1(채혼)C-P2	기준가격	1,006.08	1,006.28	0.02
단기국공채공모주1(채혼)C-W	기준가격	0.00	1,000.57	0.06

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산 총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 연말 악화된 투자심리 등을 반영해, 연초 이후 신규상장 종목의 공모가격이 낮게 형성되는 생김 가운데, 올해 초부터 지난 달까지의 IPO 건수는 지난 해보다 적은 수준이었습니다. 그러나, 예상과 달리 일부 종목들이 상장 후 가격이 급등함에 따라 채차 투자심리가 개선되고 있는 상황입니다.

5월 채권시장은 한국은행과 정부가 국책은행 자본확충에 대한 공감대를 형성함에 따라 선제적인 기준금리 인하에 대한 기대감으로 강세 출발하였습니다. 그러나 5월 금통위에서 만장일치로 기준금리가 동결되고, 4월 FOMC 의사록에서 연준이 6월 금리인상가능성을 열어둠에 따라 채권금리는 상승 반전하였습니다. 월말 KDI가 국내 성장을 전망치를 하향 조정하며 금리인하 필요성을 언급함에 따라 금리 상승폭을 일부 되돌리며 마감하였으며 국고 3년물 기준으로는 +4.3bp 상승하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

6월에는 올해 가장 많은 기업이 수요예측 조사를 기다리고 있으며, 하반기에는 '호텔롯데'와 같은 대형 IPO도 일정에 포함되어 시장의 관심이 높아질 것으로 기대하고 있습니다. 당사는 신규상장 기업들의 적정가치와 시장상황을 고려하여 투자기회를 모색할 계획입니다. 채권부분은 최근 공개된 5월 금통위 의사록에서 기준금리 인하 의견이 있었기 때문에 6월 금통위에서 기준금리 인하 가능성을 배제할 수 없고 연내 금리인하 가능성이 높은 상황이기 때문에 금리 상승 시에는 저가매수 위주로 대응할 계획입니다. 또한, 기준금리 인하 기대감으로 국고채 금리가 낮은 수준에서 머물고 있기 때문에 금리 메리트가 있는 특수채는 지속적으로 편입할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	0.19	1.18	1.61	4.02
(비교지수 대비 성과)	(-0.26)	(0.30)	(0.09)	(2.55)
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	0.02	0.84	1.09	3.31
(비교지수 대비 성과)	(-0.43)	(-0.04)	(-0.43)	(1.83)
단기국공채공모주1(채훈)Ae	0.06	0.93	1.23	3.50
(비교지수 대비 성과)	(-0.38)	(0.05)	(-0.29)	(2.02)
단기국공채공모주1(채훈)C	-0.04	0.71	0.90	3.05
(비교지수 대비 성과)	(-0.49)	(-0.17)	(-0.62)	(1.58)
단기국공채공모주1(채훈)Ce	0.03	0.86	1.13	3.36
(비교지수 대비 성과)	(-0.41)	(-0.02)	(-0.39)	(1.89)
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	0.02	0.84	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.43)	(-0.04)	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C-W	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.45	0.88	1.52	1.48

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 5.0%, 국공채 1년-1년6개월 90.0%, CALL 5.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	4.02	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(2.55)	-	-	-
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	3.31	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(1.83)	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)Ae	3.50	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(2.02)	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C	3.05	-	-	-

(비교지수 대비 성과)	(1.58)	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)Ce	3.36	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(1.89)	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C-W	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	1.48	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 5.0%, 국공채 1년-1년6개월 90.0%, CALL 5.0%

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

▶ **손익현황**

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	243	468	0	0	0	0	0	0	0	0	50	761
당기	-194	343	0	3	0	0	0	0	0	1	64	217

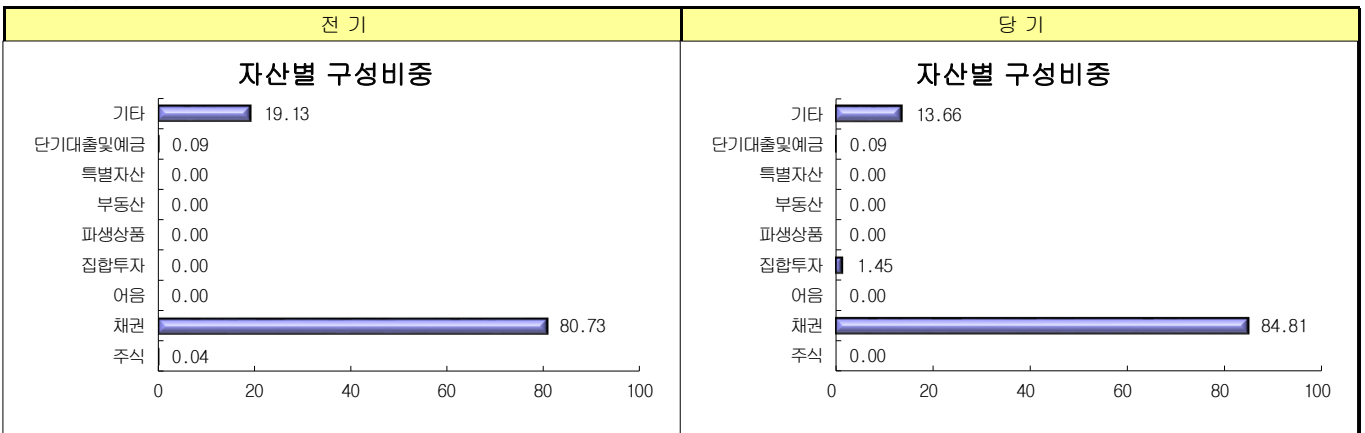
3. 자산현황

▶ **자산구성현황**

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	118,001	0	2,012	0	0	0	0	0	129	19,001	139,143
(0.00)	(0.00)	(84.81)	(0.00)	(1.45)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.09)	(13.66)	(100.00)
합계	0	118,001	0	2,012	0	0	0	0	0	129	19,001	139,143

* () : 구성 비중



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

구분	구분	종목명	비중	구분	구분	종목명	비중
1	채권	통안0146-1804-02	14.40	6	채권	국고02750-1709(12-4)	7.34
2	채권	통안0170-1708-02	12.04	7	채권	한국철도공사101	7.33
3	단기상품	REPO매수(20160523)	11.07	8	채권	국고02750-1706(14-3)	6.63
4	채권	국고03500-1703(12-1)	8.53	9	채권	통안0156-1710-02	3.75
5	채권	토지주택채권182	7.37	10	채권	국고01750-1812(15-7)	2.63

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 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

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안0146-1804-02	20,000	20,034	대한민국	KRW	2016-04-02	2018-04-02		N/A	14.40
통안0170-1708-02	16,700	16,758	대한민국	KRW	2015-08-02	2017-08-02		N/A	12.04
국고03500-1703(12-1)	11,600	11,866	대한민국	KRW	2012-03-10	2017-03-10		N/A	8.53
토지주택채권182	10,000	10,256	대한민국	KRW	2013-02-07	2018-02-07		AAA	7.37
국고02750-1709(12-4)	10,000	10,216	대한민국	KRW	2012-09-10	2017-09-10		N/A	7.34
한국철도공사101	10,000	10,194	대한민국	KRW	2013-01-17	2017-01-17		AAA	7.33
국고02750-1706(14-3)	9,000	9,229	대한민국	KRW	2014-06-10	2017-06-10		N/A	6.63
통안0156-1710-02	5,200	5,216	대한민국	KRW	2015-10-02	2017-10-02		N/A	3.75
국고01750-1812(15-7)	3,600	3,654	대한민국	KRW	2015-12-10	2018-12-10		N/A	2.63

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 기타

(단위 : 백만원)

종류	평가금액	비고
기타	19,001	

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력

(단위: 개, 백만원)

성명	직위	출생년도	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
채경섭	주식 책임운용역	1974	9	1,292	-	-	2109000941
김지상	주식 부책임운용역	1985	0	0	-	-	2115000373
정승호	채권 책임운용역	1975	12	1,207	-	-	2110000746

▶ 운용전문인력 최근 변경 내역

운용전문인력	직위	운용기간
김지상	부책임운용역	2016.01.04~현재

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

구분	전기		당기			
	금액	비율	금액	비율		
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	자산운용사	0	0.00	0	0.00	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.00	
	기타비용**	1	0.00	2	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	4	0.00	3	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	4	0.00	3	0.00
	증권거래세	7	0.01	4	0.00	

단기국공채공모주1(채훈)A	자산운용사	29	0.08	43	0.07	
	판매회사	34	0.09	50	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	2	0.01	3	0.00	
	일반사무관리회사	1	0.00	2	0.00	
	보수합계	66	0.17	98	0.17	
	기타비용**	1	0.00	1	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	2	0.00	2	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	2	0.00	2	0.00
	증권거래세	3	0.01	2	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)Ae	자산운용사	2	0.08	3	0.07	
	판매회사	1	0.04	1	0.04	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	4	0.13	4	0.12	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.01	0	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)C	자산운용사	27	0.08	38	0.07	
	판매회사	54	0.15	76	0.15	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	2	0.01	3	0.00	
	일반사무관리회사	1	0.00	2	0.00	
	보수합계	84	0.24	118	0.23	
	기타비용**	1	0.00	1	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	2	0.00	1	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	2	0.00	1	0.00
	증권거래세	3	0.01	2	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)Ce	자산운용사	1	0.08	2	0.07	
	판매회사	1	0.08	2	0.07	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	2	0.16	4	0.16	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.01	0	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	자산운용사	0	0.08	0	0.07	
	판매회사	0	0.09	0	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.17	0	0.17	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.01	0	0.00	
	자산운용사	0	0.00	0	0.06	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.06	

단기국공채공모주1(채훈)C-W	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세		0	0.00	0	0.00

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

※ 성과보수내역 :

※ 발행분담금내역 :

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	전기	0	0	0
	당기	0.1034	0.1986	0.302
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	전기	0.7048	0.0211	0.7259
	당기	0.7023	0.0166	0.7189
단기국공채공모주1(채훈)Ae	전기	0.5221	0.022	0.5441
	당기	0.5215	0.0187	0.5402
단기국공채공모주1(채훈)C	전기	0.9598	0.0207	0.9805
	당기	0.9573	0.0174	0.9747
단기국공채공모주1(채훈)Ce	전기	0.652	0.0214	0.6734
	당기	0.6527	0.0192	0.6719
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	전기	0.704	0.0177	0.7217
	당기	0.6964	0.0133	0.7097
단기국공채공모주1(채훈)C-W	전기	0	0	0
	당기	0.3403	0.0118	0.3521

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

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	87,286	1,409	726.11	2944.80

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

15년08월24일 ~15년11월23일	15년11월24일 ~16년02월23일	16년02월24일 ~16년05월23일
360.66	335.82	726.11

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '기업은행, 신한은행, 우리은행'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용
금융투자협회

<http://www.midasasset.com>
<http://dis.kofia.or.kr>

/ 02-3787-3500