

# 자산운용보고서

마이다스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁 채권혼합

(운용기간 : 2016년03월09일 ~ 2016년06월08일)

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
  - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
  - ▶ 운용경과
  - ▶ 투자환경 및 운용계획
  - ▶ 기간(누적)수익률
  - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
  - ▶ 자산구성현황
  - ▶ 환해지에 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 회전을
  - ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

# 1. 펀드의 개요

## ▶ 기본정보      자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이더스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)(운용), 마이더스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)A, 마이더스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)C, 마이더스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)C-P, 마이더스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)Ce, 마이더스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)S, 마이더스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)S-P		3등급	B0147, B0148, B0149, B0153, B0150, B0155, B0156
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형	최초설정일	2015.03.09
운용기간	2016.03.09 ~ 2016.06.08	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	교보증권,대신증권,미래에셋대우,키움증권,펀드온라인코리아, 하나금융투자	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 국내 채권을 주된 투자대상자산으로 하여 신탁재산의 90% 이하를 투자하고 국내 주식에 신탁재산의 30% 이하를 투자하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 국공채, 지방채, 특수채 등 우량채권에 투자하며 듀레이션을 최대한 중립적으로 유지하는 전략을 활용하여 금리변동 위험에 대비해 안정적인 채권이자수익을 추구합니다. 주식 전략에서는 '핵심 포트폴리오(Core Portfolio)'를 구성하여 적극적인 초과성적을 추구합니다.		

## ▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
뉴트렌드30(채혼)(운용)	자산 총액 (A)	9,855	10,117	2.66
	부채 총액 (B)	0	43	64968.76
	순자산총액 (C=A-B)	9,855	10,074	2.23
	발행 수익증권 총 수 (D)	9,666	9,720	0.56
	기준가격 <sup>주)</sup> (E=C/D×1000)	1,019.50	1,036.44	1.66
종류(Class)별 기준가격 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	기준가격	1,009.09	1,014.22	1.42
뉴트렌드30(채혼)C	기준가격	1,023.97	1,013.20	1.32
뉴트렌드30(채혼)Ce	기준가격	1,016.39	1,001.27	1.44
뉴트렌드30(채혼)C-P	기준가격	1,034.42	1,007.19	1.40
뉴트렌드30(채혼)S	기준가격	1,042.47	1,014.85	1.48
뉴트렌드30(채혼)S-P	기준가격	1,024.59	1,004.43	1.50

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 분기, 펀드는 1.42%(클래스 A 기준)의 수익률을 기록하여 벤치마크 대비 -0.08%p 낮은 성과를 기록하였습니다. 펀드 내 편입비중이 높은 전기전자, 화학, 서비스 업종의 성과가 우수하였지만 유통업, 운수장비 등의 업종 성과가 시장 대비 저조하여 전체적으로 벤치마크 대비 소폭 낮은 성과를 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

지난 6월 한달간 KOSPI는 0.66%, KOSDAQ은 3.34% 하락하였습니다. 월초 발표된 미국 고용지표 부진으로 기준금리 인상 확률이 낮아졌고 국내 기준금리 인하 등으로 KOSPI는 상승 출발했습니다. 그러나, 시장의 예상과 달리 영국의 'EU 탈퇴'가 결정되어, 이는 시장에 단기적 충격으로 작용했습니다. 국내증시는 3% 하락했으나 정부의 '추경편성안' 발표와 함께 공매도 공시법 시행을 앞두고 '숏 커버'가 유입되며 월말에 주가가 상승, 1,970p대로 마감했습니다. 업종별로는 전기전자, 의약품, 제조업 등이 양호했으나 의료정밀, 기계, 보험, 서비스업 등은 약세를 보였습니다. 채권시장은 5월 한국 금통위 의사록에서 "조속한 시일 내 금리인하가 필요하다"는 소수의견이 확인되면서 강제로 출발했습니다. 이후, 미국 고용지표 쇼크로 6월 금리인상에 대한 우려가 다소 완화되고 국책은행 자본확충에 있어 한국은행의 역할이 정해지며, 금리인하 기대감이 확산했습니다. 6월 금통위에서는 기준금리를 인하하였고, 추가 인하에 대한 여지도 있어 시장금리는 매우 낮은 수준에서 유지되었으며, 이후 '브렉시트' 우려로 시장금리는 추가 하락했습니다. 포트폴리오 듀레이션은 금리 레벨 부담에도 불구하고 기준금리 인하 기대감이 지속됨에 따라 '중립~중립 이상' 수준에서 유지했습니다. 포트폴리오는 국고 및 통안채 위주로 안정성과 유동성이 높은 채권 위주로 운용했습니다. 6월 금통위에서 기준금리를 단행하였으나 국내 경기부진 지속으로 기준금리 인하 사이클이 종료되지 않은 것으로 판단되어, 하반기에도 기준금리 인하 기대감이 유지될 것으로 판단됩니다. 따라서, 금리 상승시에는 저가매수 위주로 대응할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
뉴트렌드30(채훈)(운용)	1.66	1.33	1.66	-0.04
(비교지수 대비 성과)	(0.16)	(-0.74)	(-1.67)	(-1.24)
종류(Class)별 현황				
뉴트렌드30(채훈)A	1.42	0.86	0.94	-0.99
(비교지수 대비 성과)	(-0.08)	(-1.21)	(-2.39)	(-2.19)
뉴트렌드30(채훈)C	1.32	0.65	0.64	-1.39
(비교지수 대비 성과)	(-0.18)	(-1.42)	(-2.70)	(-2.59)
뉴트렌드30(채훈)Ce	1.44	0.88	0.98	-0.93
(비교지수 대비 성과)	(-0.06)	(-1.19)	(-2.35)	(-2.13)
뉴트렌드30(채훈)C-P	1.40	0.81	0.87	-1.07
(비교지수 대비 성과)	(-0.10)	(-1.26)	(-2.46)	(-2.28)
뉴트렌드30(채훈)S	1.48	0.98	1.13	-0.73
(비교지수 대비 성과)	(-0.01)	(-1.09)	(-2.20)	(-1.94)
뉴트렌드30(채훈)S-P	1.50	1.02	1.19	-0.66
(비교지수 대비 성과)	(0.01)	(-1.05)	(-2.15)	(-1.86)
비교지수(벤치마크)	1.50	2.07	3.33	1.20

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 27.0%, 매경BP국공채(1~2년) 73.0%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
뉴트렌드30(채훈)(운용)	-0.04	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-1.24)	-	-	-
종류(Class)별 현황				
뉴트렌드30(채훈)A	-0.99	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-2.19)	-	-	-
뉴트렌드30(채훈)C	-1.39	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-2.59)	-	-	-
뉴트렌드30(채훈)Ce	-0.93	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-2.13)	-	-	-
뉴트렌드30(채훈)C-P	-1.07	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-2.28)	-	-	-
뉴트렌드30(채훈)S	-0.73	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-1.94)	-	-	-
뉴트렌드30(채훈)S-P	-0.66	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-1.86)	-	-	-
비교지수(벤치마크)	1.20	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI 27.0%, 매경BP국공채(1~2년) 73.0%

※ 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	-81	52	0	0	0	0	0	0	0	0	-2	-31
당기	131	32	0	0	0	0	0	0	0	0	0	164

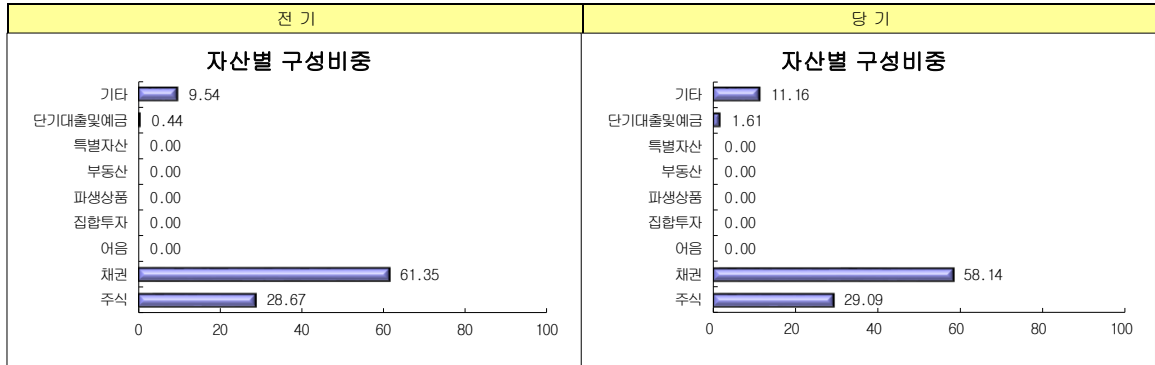
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	2,943	5,882	0	0	0	0	0	0	0	163	1,130	10,117
(0.00)	(29.09)	(58.14)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(1.61)	(11.16)	(100.00)
합계	2,943	5,882	0	0	0	0	0	0	0	163	1,130	10,117

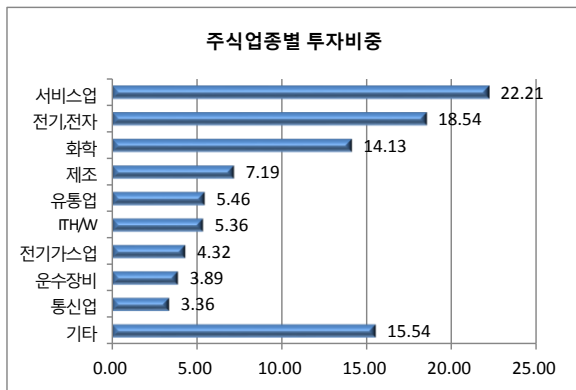
\* ( ) : 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	서비스업	22.21	6	IT H/W	5.36
2	전기,전자	18.54	7	전기가스업	4.32
3	화학	14.13	8	운수장비	3.89
4	제조	7.19	9	통신업	3.36
5	유통업	5.46	10	기타	15.54



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	채권	국고01750-1812(15-7)	30.18	6	단기상품	은대	1.61
2	채권	통안0156-1710-02	19.87	7	주식	한국전력	1.26
3	단기상품	REPO매수(20160608)	10.87	8	주식	삼성전자우	1.14
4	채권	국고03000-1612(13-7)	8.09	9	주식	NAVER	1.07
5	주식	삼성전자	3.89	10	주식	아모레G	1.03

\*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

▶ 주식

(단위 : 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	280	394	3.89	대한민국	KRW	전기,전자	
한국전력	2,100	127	1.26	대한민국	KRW	전기가스업	
삼성전자우	100	115	1.14	대한민국	KRW	전기,전자	
NAVER	150	108	1.07	대한민국	KRW	서비스업	
아모레G	600	104	1.03	대한민국	KRW	서비스업	

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 채권

(단위 : 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고01750-1812(15-7)	3,000	3,054	대한민국	KRW	2015-12-10	2018-12-10		N/A	30.18
통안0156-1710-02	2,000	2,010	대한민국	KRW	2015-10-02	2017-10-02		N/A	19.87
국고03000-1612(13-7)	800	818	대한민국	KRW	2013-12-10	2016-12-10		N/A	8.09

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	신한은행	2015-03-09	163	1.15		대한민국	KRW

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

▶ 기타

(단위 : 백만원)

종류	평가금액	비고
기타	1,130	

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	
이하윤	주식 책임운용역	1979	2	약 3,378억	-	-	2110000009
정승호	채권 책임운용역	1975	12	약 2,223억	-	-	2110000746

▶ 운용전문인력 최근 변경 내역

- 해당사항 없음

## 5. 비용 현황

### ▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
뉴트렌드30(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**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	4	0.04	3	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	4	0.04	3	0.03
	증권거래세	5	0.05	5	0.05	
뉴트렌드30(채훈)A	자산운용사	1	0.10	1	0.10	
	판매회사	1	0.12	1	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	2	0.23	2	0.24	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	0	0.04	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.04	0	0.03
	증권거래세	0	0.05	0	0.05	
뉴트렌드30(채훈)C	자산운용사	8	0.10	9	0.10	
	판매회사	19	0.22	19	0.23	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	28	0.33	29	0.34	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	3	0.04	3	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	3	0.04	3	0.03
	증권거래세	5	0.05	4	0.05	
뉴트렌드30(채훈)Ce	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.11	0	0.11	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.22	0	0.22	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	0	0.04	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.04	0	0.03
	증권거래세	0	0.05	0	0.05	
뉴트렌드30(채훈)C-P	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.15	0	0.15	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.26	0	0.26	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매. 중개수수료	0	0.04	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.04	0	0.03
	증권거래세	0	0.06	0	0.05	

뉴트렌드30(채혼)S	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.06	0	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
	보수합계	1	0.17	1	0.17	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.04	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.04	0	0.03
	증권거래세	0	0.05	0	0.05	
뉴트렌드30(채혼)S-P	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.04	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.15	0	0.16	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.04	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.04	0	0.03
	증권거래세	0	0.05	0	0.05	

\* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

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

※ 성과보수내역 :

※ 발행분담금내역 :

### ▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
뉴트렌드30(채혼)(운용)	전기	0	0	0
	당기	0.0383	1.7045	1.7428
종류(Class)별 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	전기	0.9589	0.192	1.1509
	당기	0.9558	0.1571	1.1129
뉴트렌드30(채혼)C	전기	1.3662	0.1754	1.5416
	당기	1.3612	0.1538	1.515
뉴트렌드30(채혼)Ce	전기	0.904	0.1616	1.0656
	당기	0.9034	0.1541	1.0575
뉴트렌드30(채혼)C-P	전기	1.0549	0.1593	1.2142
	당기	1.054	0.1501	1.2041
뉴트렌드30(채혼)S	전기	0.7033	0.1671	0.8704
	당기	0.7031	0.1555	0.8586
뉴트렌드30(채혼)S-P	전기	0.6303	0.162	0.7923
	당기	0.6299	0.1527	0.7826

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔액(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 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전을(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
33,170	1,530	34,614	1,564	54.23	215.16

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

### ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

15년09월09일 ~15년12월08일	15년12월09일 ~16년03월08일	16년03월09일 ~16년06월08일
62.76	62.57	54.23

## 공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드 재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '교보증권,대신증권,미래에셋대우,키움증권,펀드온라인코리아,하나금융투자'를 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