

자산운용보고서

(마이다스 뉴트렌드 30 증권 투자신탁(채권혼합)

(운용기간 : 2016년06월09일 ~ 2016년09월08일)

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
 - ▶ 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
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		4등급	B0147, B0148, B0149, B0153, B0150, B0155, B0156
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형	최초설정일	2015.03.09
운용기간	2016.06.09 ~ 2016.09.08	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 초과성과를 추구합니다.		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
뉴트렌드30(채혼)(운용)	자산 총액 (A)	10,117	9,700	-4.13
	부채 총액 (B)	43	71	64.70
	순자산총액 (C=A-B)	10,074	9,629	-4.42
	발행 수익증권 총 수 (D)	9,720	9,353	-3.78
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,036.44	1,029.52	-0.67
종류(Class)별 기준가격 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	기준가격	1,014.22	1,005.06	-0.90
뉴트렌드30(채혼)C	기준가격	1,013.20	1,003.04	-1.00
뉴트렌드30(채혼)Ce	기준가격	1,001.27	992.36	-0.89
뉴트렌드30(채혼)C-P	기준가격	1,007.19	997.85	-0.93
뉴트렌드30(채혼)S	기준가격	1,014.85	1,006.33	-0.84
뉴트렌드30(채혼)S-P	기준가격	1,004.43	996.17	-0.82

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.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

지난 분기, 펀드는 Class A 기준 -0.90%의 수익률을 기록하여 비교지수 대비 -1.78% 하회하였습니다. 펀드 내 편입 비중이 높은 전기전자와 운수장비의 성과가 우수하였지만, KOSDAQ, 서비스, 화학 업종의 성과가 시장 대비 저조하여 전체적으로 벤치마크 대비 낮은 성과를 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

지난 9월에는 전기전자와 운수장비 그리고 서비스 업종의 비중을 높게 유지하였습니다. 유틸리티, 통신, 화학 등의 비중은 더욱 축소시킨 가운데 반도체, 정유업종, 서비스 업종의 지주사 및 엔터테인먼트 섹터의 비중을 확대했습니다. 9월말 기준 펀드의 주력업종은 전기전자 업종과 운수장비 중 부품업종, 방산 및 기계관련 업종, 그리고 서비스 업종입니다. 펀드 주식 보유 내역 중 편입 비중이 높았던 서비스와 KOSDAQ을 포함하는 중소형주는 펀드성과에 긍정적인 영향을 미쳤습니다. 그러나, 9월에 주가가 양호했던 음식료, 섬유·의복 섹터에 대한 비중이 낮았던 점과 월말 한미약품, 만도 등 펀드 주력종목들이 개별기업 이슈로 주가가 하락한 것이 전체적인 펀드성과에 부정적인 영향을 미쳐 펀드는 KOSPI대비 낮은 수익률을 기록했습니다. 9월 금통위에서 만장일치로 기준금리를 동결하면서 연내 기준금리 인하 기대감이 약화되고 있습니다. 하지만 단기 금리가 기준금리를 상회하여 역마진이 해소됨에 따라 포트폴리오 듀레이션은 중립~중립 이상 수준에서 유지하였습니다. 포트폴리오 섹터는 국고 및 통안채 위주로 안정성과 유동성 높은 채권 위주로 운용하였습니다. 미국 연준의 12월 금리 인상 가능성이 높지만 수출 부진과 김영란법 시행 및 구조조정에 따른 내수 부진으로 국내 단기 금리가 의미있게 오르는 힘들다고 판단되어 금리 상승 시에는 포트폴리오 듀레이션은 확대하여 대응할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
뉴트렌드30(채혼)(운용)	-0.67	0.98	0.66	0.98
(비교지수 대비 성과)	(-1.54)	(-1.40)	(-2.31)	(-3.25)
종류(Class)별 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	-0.90	0.51	-0.05	0.03
(비교지수 대비 성과)	(-1.78)	(-1.88)	(-3.02)	(-4.20)
뉴트렌드30(채혼)C	-1.00	0.30	-0.36	-0.37
(비교지수 대비 성과)	(-1.88)	(-2.08)	(-3.32)	(-4.61)
뉴트렌드30(채혼)Ce	-0.89	0.53	-0.02	0.08
(비교지수 대비 성과)	(-1.76)	(-1.85)	(-2.98)	(-4.15)
뉴트렌드30(채혼)C-P	-0.93	0.46	-0.13	-0.07
(비교지수 대비 성과)	(-1.80)	(-1.93)	(-3.09)	(-4.30)
뉴트렌드30(채혼)S	-0.84	0.63	0.13	0.28
(비교지수 대비 성과)	(-1.71)	(-1.75)	(-2.83)	(-3.95)
뉴트렌드30(채혼)S-P	-0.82	0.67	0.19	0.35
(비교지수 대비 성과)	(-1.70)	(-1.72)	(-2.77)	(-3.88)
비교지수(벤치마크)	0.87	2.39	2.96	4.23

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(채혼)(운용)	0.98	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-3.25)	-	-	-
종류(Class)별 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	0.03	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.20)	-	-	-
뉴트렌드30(채혼)C	-0.37	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.61)	-	-	-
뉴트렌드30(채혼)Ce	0.08	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.15)	-	-	-
뉴트렌드30(채혼)C-P	-0.07	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-4.30)	-	-	-
뉴트렌드30(채혼)S	0.28	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-3.95)	-	-	-
뉴트렌드30(채혼)S-P	0.35	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-3.88)	-	-	-
비교지수(벤치마크)	4.23	-	-	-

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	131	32	0	0	0	0	0	0	0	4	-4	164
당기	-94	26	0	0	0	0	0	0	0	3	0	-65

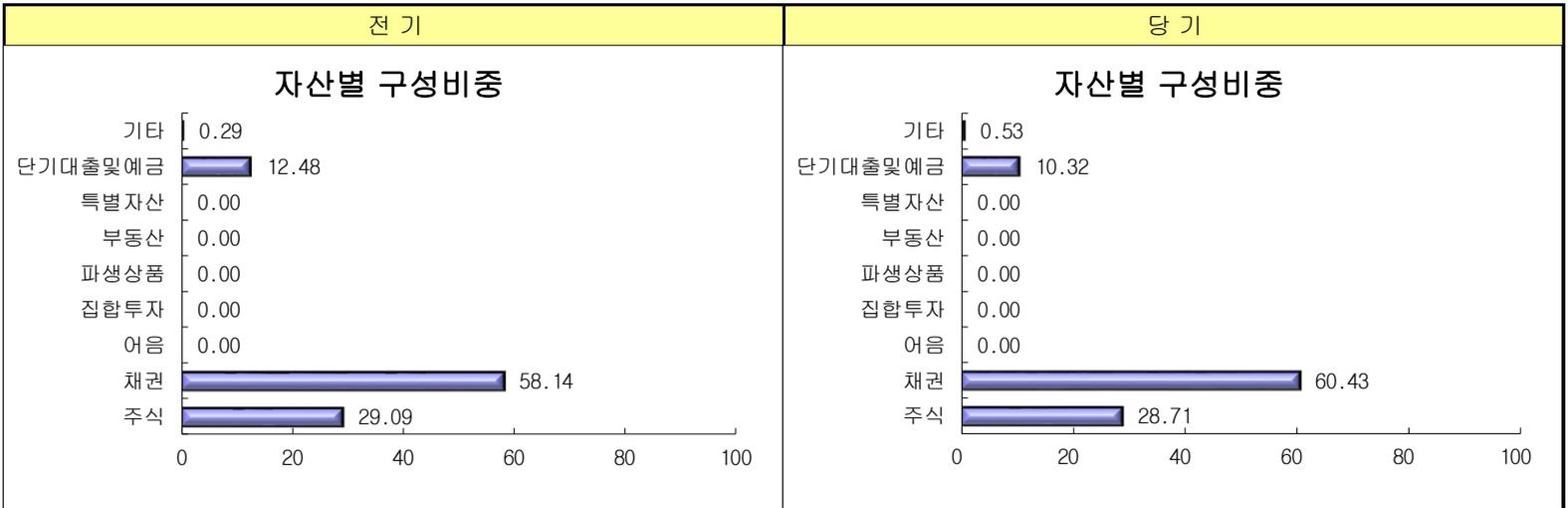
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	2,785	5,862	0	0	0	0	0	0	0	1,001	52	9,700
(0.00)	(28.71)	(60.43)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(10.32)	(0.53)	(100.00)
합계	2,785	5,862	0	0	0	0	0	0	0	1,001	52	9,700

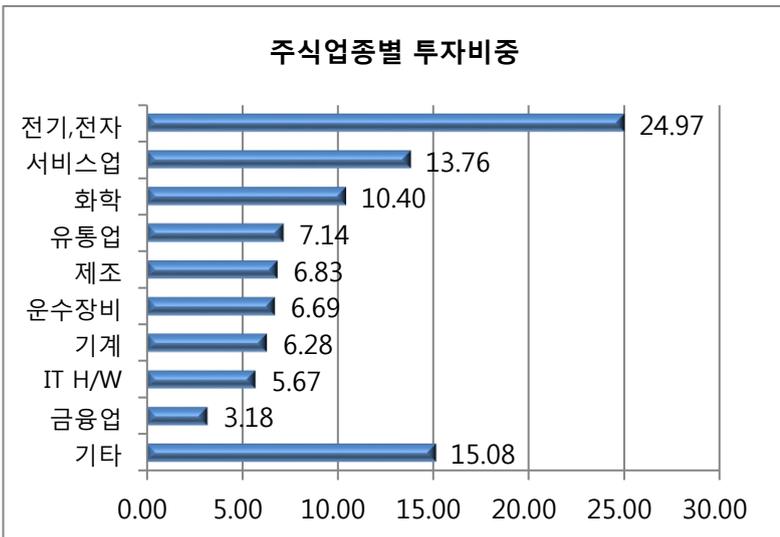
* () : 구성 비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	24.97	6	운수장비	6.69
2	서비스업	13.76	7	기계	6.28
3	화학	10.40	8	IT H/W	5.67
4	유통업	7.14	9	금융업	3.18
5	제조	6.83	10	기타	15.08



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	채권 국고01750-1812(15-7)	31.37	6	주식 삼성물산	1.38
2	채권 통안0156-1710-02	20.74	7	주식 NAVER	1.08
3	단기상품 REPO매수(20160908)	9.28	8	단기상품 은대	1.04
4	채권 국고01500-1906(16-2)	8.33	9	주식 현대엘리베이	0.90
5	주식 삼성전자	4.90	10	주식 POSCO	0.84

※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	290	475	4.90	대한민국	KRW	전기,전자	
삼성물산	900	134	1.38	대한민국	KRW	유통업	
NAVER	120	104	1.08	대한민국	KRW	서비스업	
현대엘리베이	1,300	87	0.90	대한민국	KRW	기계	
POSCO	350	81	0.84	대한민국	KRW	철강및금속	

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	3,043	대한민국	KRW	2015-12-10	2018-12-10		N/A	31.37
통안0156-1710-02	2,000	2,011	대한민국	KRW	2015-10-02	2017-10-02		N/A	20.74
국고01500-1906(16-2)	800	808	대한민국	KRW	2016-06-10	2019-06-10		N/A	8.33

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	101	0.92		대한민국	KRW
REPO매수	한국자금중개	2016-09-08	933	0.01		대한민국	KRW

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 2,570억	-	-	2110000009
정승호	채권 책임운용역	1975	12	약 2,663억	-	-	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.중개수수료	단순매매.중개수수료	3	0.03	5	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	3	0.03	5	0.05
	증권거래세	5	0.05	7	0.07	
뉴트렌드30(채훈)A	자산운용사	1	0.10	1	0.10	
	판매회사	1	0.13	1	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
	보수합계	2	0.24	2	0.24	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.05
	증권거래세	0	0.05	1	0.07	
뉴트렌드30(채훈)C	자산운용사	9	0.10	9	0.10	
	판매회사	19	0.23	19	0.23	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
	보수합계	29	0.34	29	0.34	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매.중개수수료	단순매매.중개수수료	3	0.03	4	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	3	0.03	4	0.05
	증권거래세	4	0.05	6	0.07	
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.중개수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.05
	증권거래세	0	0.05	0	0.07	
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.중개수수료	0	0.03	0	0.05	
	증권거래세	0	0.05	0	0.07	

	매매·중개수수료	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.05
	증권거래세	0	0.05	0	0.07	
뉴트렌드30(채혼)S	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.06	0	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
	보수합계	1	0.17	0	0.17	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.03	0	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
합계		0	0.03	0	0.05	
증권거래세	0	0.05	0	0.07		
뉴트렌드30(채혼)S-P	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.05	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.16	0	0.16	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.03	0	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.05
	증권거래세	0	0.05	0	0.07	

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 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)
뉴트렌드30(채혼)(운용)	전기	0.0383	1.7045	1.7428
	당기	0.0105	0.4589	0.4694
종류(Class)별 현황				
뉴트렌드30(채혼)A	전기	0.9558	0.1571	1.1129
	당기	0.9534	0.1536	1.107
뉴트렌드30(채혼)C	전기	1.3612	0.1538	1.515
	당기	1.3569	0.1548	1.5117
뉴트렌드30(채혼)Ce	전기	0.9034	0.1541	1.0575
	당기	0.9008	0.1532	1.054
뉴트렌드30(채혼)C-P	전기	1.054	0.1501	1.2041
	당기	1.0503	0.1553	1.2056
뉴트렌드30(채혼)S	전기	0.7031	0.1555	0.8586
	당기	0.701	0.1528	0.8538
뉴트렌드30(채혼)S-P	전기	0.6299	0.1527	0.7826
	당기	0.6279	0.1541	0.782

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 회전율

(단위 : 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
56,607	2,196	46,876	2,272	80.28	318.50

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

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

15년12월09일 ~16년03월08일	16년03월09일 ~16년06월08일	16년06월09일 ~16년09월08일
62.57	54.23	80.28

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 뉴트랜드 30 증권 투자신탁(채권혼합)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '신한은행'의 확인을 받아 판매회사인 '교보증권, 대신증권, 미래에셋대우, 키움증권, 펀드온라인코리아, 하나금융투자'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.co>
<http://dis.kofia.or.kr>

/ 02-3787-3500