

자산운용보고서

(마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용

(운용기간 : 2016년06월18일 ~ 2016년09월17일)

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 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용), 마이더스 커버드콜 증권 투자회사(주식)A1, 마이더스 커버드콜 증권 투자회사(주식)C3, 마이더스 커버드콜 증권 투자회사(주식)C4, 마이더스 커버드콜 증권 투자회사(주식)C5		3등급	34270, 71281, 28691, 28692, 28693
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형	최초설정일	2002.04.19
운용기간	2016.06.18 ~ 2016.09.17	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이더스에셋자산운용	펀드재산보관회사	국민은행
판매회사	KEB하나은행, NH투자증권, 교보생명보험, 교보증권, 국민은행, 대신증권, 미래에셋대우, 미래에셋증권, 삼성증권, 스탠다드차타 드은행, 신한금융투자, 신한은행, 하나금융투자, 하이투자증권, 한 국씨티은행(판매_한미(구), 한화투자증권, 현대증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	본 상품은 주식형 펀드로서 주식에 60% 이상 투자하고 있습니다. 주식은 적극적인 종목선정을 통하여 주식시장 이상의 수익을 올릴수 있도록 운용하고 있으며 커버드콜 전략을 병행하여 주가하락 위험에 대한 부분적인 헤지효과와 추가수익 획득을 추구합니다. 자산의 60%이상 주식에 투자되는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 있습니다. 다만 커버드콜 전략의 특성상 주가가 단기 급등할 경우 펀드수익률 상승이 제한될 수 있습니다.		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
커버드콜MF(주식)(운용)	자산 총액 (A)	8,557	7,820	-8.61
	부채 총액 (B)	64	7	-88.88
	순자산총액 (C=A-B)	8,493	7,813	-8.00
	발행 수익증권 총 수 (D)	4,873	4,487	-7.92
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,743.04	1,741.46	-0.09
종류(Class)별 기준가격 현황				
커버드콜MF(주식)A1	기준가격	876.45	872.87	-0.41
커버드콜MF(주식)C3	기준가격	848.24	845.29	-0.35
커버드콜MF(주식)C4	기준가격	848.19	843.40	-0.56
커버드콜MF(주식)C5	기준가격	828.72	824.27	-0.54

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 A Class 기준 -0.09%의 수익률을 기록하여 벤치마크 대비 2.29% 하회하였습니다. 전기전자, 운수장비 업종의 성과가 우수하였지만, 서비스, 화학, KOSDAQ 업종의 부진한 성과로 인해 펀드의 성과는 벤치마크 대비 하회하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

기존의 소비재 중심의 포트폴리오 변동은 거의 없었으나, 펀드 수익률 변동성 축소 차원에서 코스닥 및 중소형주 비중을 축소하고 낙폭과대 원자재 업종의 비중을 확대 하였습니다. 업종기준 대비 오버웨이트 업종은 제약, 화장품, 지주사, 서비스, 유틸리티등 내수관련 업종이며, 반면, 전기전자, 철강, 보험, 조선, 기계, 유통업종은 언더웨이트한 상황입니다. 펀드 편입비중이 높은 제약 및 내수업종의 주가하락이 매우 심화되어

전기	-77	0	0	0	28	0	0	0	0	0	-5	-54
당기	-7	0	0	0	17	0	0	0	0	0	-1	9

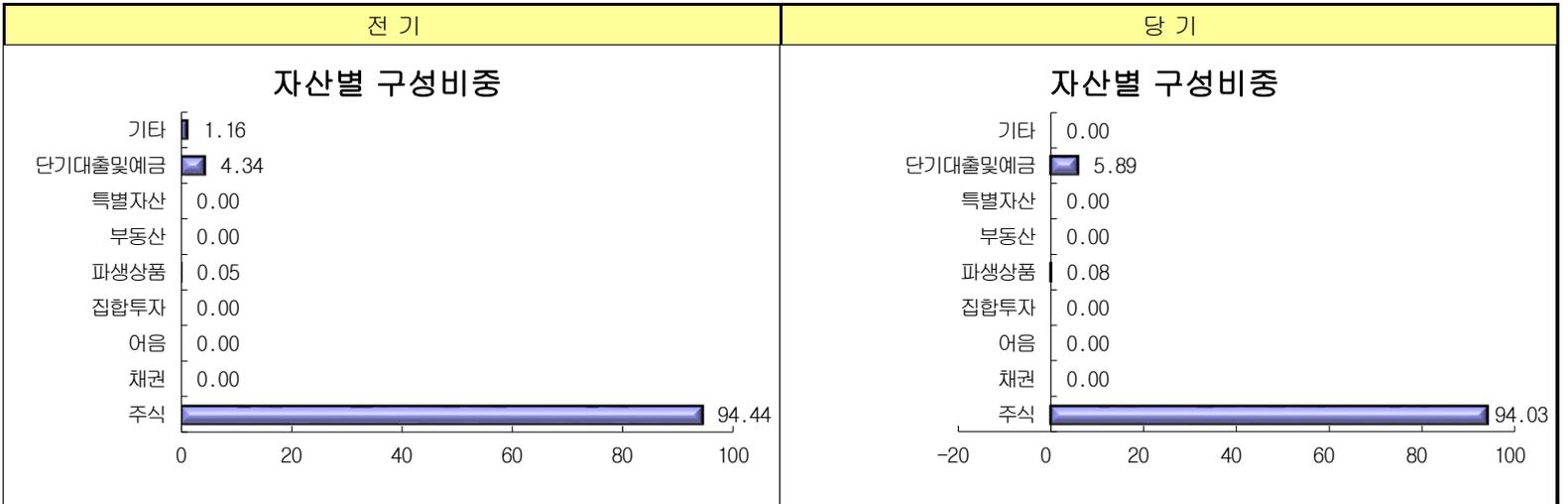
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	7,353	0	0	0	6	0	0	0	0	461	0	7,820
(0.00)	(94.03)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.08)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(5.89)	(0.00)	(100.00)
합계	7,353	0	0	0	6	0	0	0	0	461	0	7,820

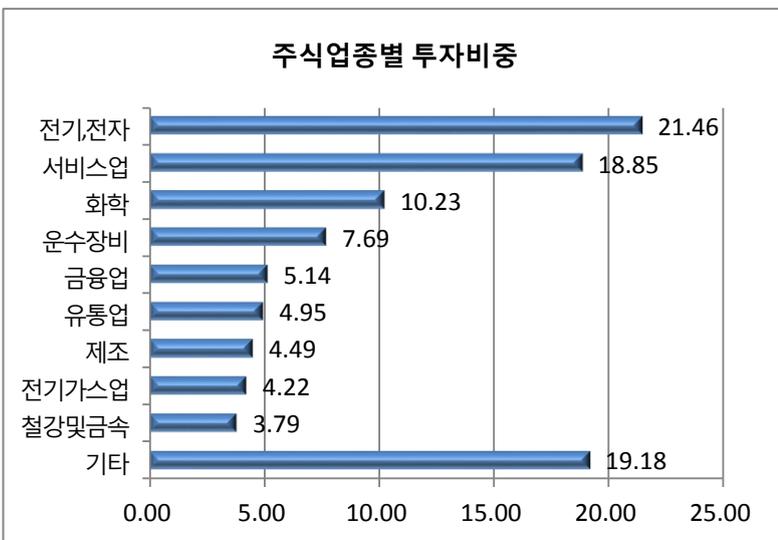
* () : 구성 비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기,전자	21.46	6	유통업	4.95
2	서비스업	18.85	7	제조	4.49
3	화학	10.23	8	전기가스업	4.22
4	운수장비	7.69	9	철강및금속	3.79
5	금융업	5.14	10	기타	19.18



▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	16.58	6	주식	아모레G	2.93
2	단기상품	보통예금	5.89	7	주식	한미약품	2.91
3	주식	한국전력	3.97	8	주식	현대차	2.72
4	주식	아모레퍼시픽	3.87	9	주식	LG생활건강	2.35

5	주식	NAVER	3.03	10	주식	삼성물산	2.29
---	----	-------	------	----	----	------	------

※모다 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	849	1,296	16.58	대한민국	KRW	전기,전자	
한국전력	5,362	310	3.97	대한민국	KRW	전기가스업	
아모레퍼시픽	800	302	3.87	대한민국	KRW	화학	
NAVER	282	237	3.03	대한민국	KRW	서비스업	
아모레G	1,497	229	2.93	대한민국	KRW	서비스업	
한미약품	415	228	2.91	대한민국	KRW	의약품	
현대차	1,534	212	2.72	대한민국	KRW	운수장비	
LG생활건강	189	184	2.35	대한민국	KRW	화학	
삼성물산	1,229	179	2.29	대한민국	KRW	유통업	

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

▶ 단기대출 및 예금

단위 : 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	국민은행	2004-01-12	461	0.10		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	
송형섭	책임운용역	1974	2	약 10억	-	-	2109000914

▶ 운용전문인력 최근 변경 내역

운용역	직위	운용 기간
허필석	책임운용역	2008.01.22 ~ 2015.07.22
송형섭	책임운용역	2015.07.23 ~ 현재
송형섭	부책임운용역	2012.05.02 ~ 2015.07.22
김민경	부책임운용역	2015.07.23 ~ 2015.11.01

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기	
		금액	비율	금액	비율
	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

커버드콜MF(주식)(운용)	기타비용**		1	0.01	1	0.01
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	3	0.03	2	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	3	0.03	2	0.02
	증권거래세		6	0.06	4	0.05
커버드콜MF(주식)A1	자산운용사		14	0.16	13	0.16
	판매회사		11	0.12	10	0.12
	펀드재산보관회사(신탁업자)		1	0.01	1	0.01
	일반사무관리회사		1	0.02	1	0.02
	보수합계		27	0.31	25	0.31
	기타비용**		1	0.01	1	0.02
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	3	0.03	2	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	3	0.03	2	0.02
	증권거래세		5	0.06	4	0.05
	커버드콜MF(주식)C3	자산운용사		0	0.00	0
판매회사		0	0.00	0	0.19	
펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00	
보수합계		0	0.00	0	0.19	
기타비용**		0	0.01	0	0.02	
매매. 중개 수수료		단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.03
증권거래세		0	0.06	0	0.05	
커버드콜MF(주식)C4		자산운용사		0	0.16	0
	판매회사		0	0.28	0	0.28
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.01	0	0.01
	보수합계		0	0.47	0	0.47
	기타비용**		0	0.01	0	0.01
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.02
	증권거래세		0	0.06	0	0.04
	커버드콜MF(주식)C5	자산운용사		1	0.16	1
판매회사		1	0.25	1	0.25	
펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사		0	0.02	0	0.02	
보수합계		2	0.44	2	0.44	
기타비용**		0	0.01	0	0.02	
매매. 중개 수수료		단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.02
증권거래세		0	0.06	0	0.05	

* 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)
커버드콜MF(주식)(운용)	전기	0.1117	0.1644	0.2761
	당기	0.0897	0.1439	0.2336

종류(Class)별 현황				
커버드콜MF(주식)A1	전기	1.3633	0.1647	1.528
	당기	1.3381	0.1442	1.4823
커버드콜MF(주식)C3	전기	2.1476	0.1492	2.2968
	당기	2.1401	0.1383	2.2784
커버드콜MF(주식)C4	전기	1.9627	0.1686	2.1313
	당기	1.9459	0.1509	2.0968
커버드콜MF(주식)C5	전기	1.8748	0.1646	2.0394
	당기	1.8476	0.1436	1.9912

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		매매회전율주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
12,178	562	24,039	1,284	16.39	65.04

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

15년12월18일 ~16년03월17일	16년03월18일 ~16년06월17일	16년06월18일 ~16년09월17일
28.52	21.95	16.39

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용)의 자산운용회사인 '마이다스에셋자산운용'이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 '국민은행'의 확인을 받아 판매회사인 'KEB하나은행, NH투자증권, 교보생명보험, 교보증권, 국민은행, 대신증권, 미래에셋대우, 미래에셋증권, 삼성증권, 스탠다드차타드은행, 신한금융투자, 신한은행, 하나금융투자, 하이투자증권, 한국씨티은행(판매_한미(구), 한화투자증권, 현대증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기가에 하합니다

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용 <http://www.midasset.co> / 02-3787-3500
금융투자협회 <http://dis.kofia.or.kr>

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모가 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용시 분산투자가 어려워 효율적인 자산운용이 곤란할 수 있습니다. 또한 법적단서에 의거하여 향후 불가피하게 임의해지를 통해 정리될 수 있음을 알려드립니다. (자본시장과 금융투자업에 관한 법률 제 192조 제1항, 동법 시행령 제 233조 제3호 및 제4호)