

자산운용보고서

(마이더스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합

(운영기간 : 2016년11월24일 ~ 2017년02월23일)

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

마이더스에셋자산운용

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		5등급	AX668, AX669, AX670, AX671, B8572, BB697, AX672
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 증류형	최초설정일	2014.11.24
운용기간	2016.11.24 ~ 2017.02.23	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	기업은행, 신한은행, 우리은행	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	투자신탁재산의 90% 이하를 국채, 통화안정증권, 우량 회사채 등의 채권에 주로 투자하며, 듀레이션을 1년 내외 수준으로 하여 금리 상승 시 자본손실의 최소화를 추구합니다. 투자신탁재산의 30% 이하를 공모주에 주로 투자하며 실권주, 블록딜 등에도 선별적으로 투자할 수 있습니다.		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
단기국공채공모주1(채혼)(운용)	자산 총액 (A)	166,081	124,153	-25.25
	부채 총액 (B)	3,993	1,481	-62.91
	순자산총액 (C=A-B)	162,088	122,672	-24.32
	발행 수익증권 총 수 (D)	151,309	117,740	-22.19
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,071.24	1,041.89	0.64
종류(Class)별 기준가격 현황				
단기국공채공모주1(채혼)A	기준가격	1,015.07	1,013.06	0.47
단기국공채공모주1(채혼)Ae	기준가격	1,016.90	1,013.53	0.51
단기국공채공모주1(채혼)C	기준가격	1,012.53	1,012.42	0.40
단기국공채공모주1(채혼)Ce	기준가격	1,015.58	1,013.19	0.48
단기국공채공모주1(채혼)C-P2	기준가격	1,012.96	1,010.83	0.47
단기국공채공모주1(채혼)C-W	기준가격	1,008.99	1,010.40	0.55

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 0.47%의 수익률을 기록하여, 비교지수 대비 -0.44% 낮은 성과를 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

16년 연말 미 연준의 기준금리인상, 국내시장의 코스닥 시장 부진이 이어지며, 공모시장은 지난2년대비 다소 소강상태를 보이고 있는 상황입니다. 다만, 한국거래소는 17년 연간 20개의 코스피 기업과 100개의 코스닥 기업 상장을 목표로 하고 있습니다. 특히나, 올해는 넷마블게임즈, 이랜드리테일, 아이엔지생명보험, 호텔롯데 등 대규모 공모를 진행할 대어급 기업들의 상장이 예정되어있어, 역대 최대규모의 공모시장이 형성될 것으로 예상됩니다. 특히나, 상장을 재도전하는 기업들의 수가 많아, 기존대비 매력 높은 구조로 상장을 진행할 확률이 높으며, 기회를 꾸준히 포착해야할 것으로 판단합니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	0.64	0.69	1.66	1.85
(비교지수 대비 성과)	(-0.27)	(0.02)	(0.15)	(-0.11)
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	0.47	0.34	1.13	1.15
(비교지수 대비 성과)	(-0.44)	(-0.33)	(-0.37)	(-0.81)
단기국공채공모주1(채훈)Ae	0.51	0.44	1.27	1.33
(비교지수 대비 성과)	(-0.40)	(-0.24)	(-0.24)	(-0.62)
단기국공채공모주1(채훈)C	0.40	0.22	0.94	0.90
(비교지수 대비 성과)	(-0.51)	(-0.46)	(-0.57)	(-1.06)
단기국공채공모주1(채훈)Ce	0.48	0.37	1.17	1.20
(비교지수 대비 성과)	(-0.43)	(-0.30)	(-0.34)	(-0.76)
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	0.47	0.35	1.13	1.15
(비교지수 대비 성과)	(-0.44)	(-0.33)	(-0.37)	(-0.81)
단기국공채공모주1(채훈)C-W	0.55	0.52	1.40	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.35)	(-0.15)	(-0.10)	-
비교지수(벤치마크)	0.91	0.67	1.51	1.96

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)	1.85	6.33	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.11)	(2.15)	-	-
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	1.15	4.88	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.81)	(0.70)	-	-
단기국공채공모주1(채훈)Ae	1.33	5.25	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.62)	(1.08)	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C	0.90	4.35	-	-

(비교지수 대비 성과)	(-1.06)	(0.18)	-	-
단기국공채공모주1(채훈)Ce	1.20	4.98	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.76)	(0.81)	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	1.15	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.81)	-	-	-
단기국공채공모주1(채훈)C-W	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	1.96	4.18	-	-

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

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

▶ **손익현황**

(단위 : 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전 기	517	-491	0	3	0	0	0	0	0	62	-5	86
당 기	6	834	0	9	0	0	0	0	0	56	-4	901

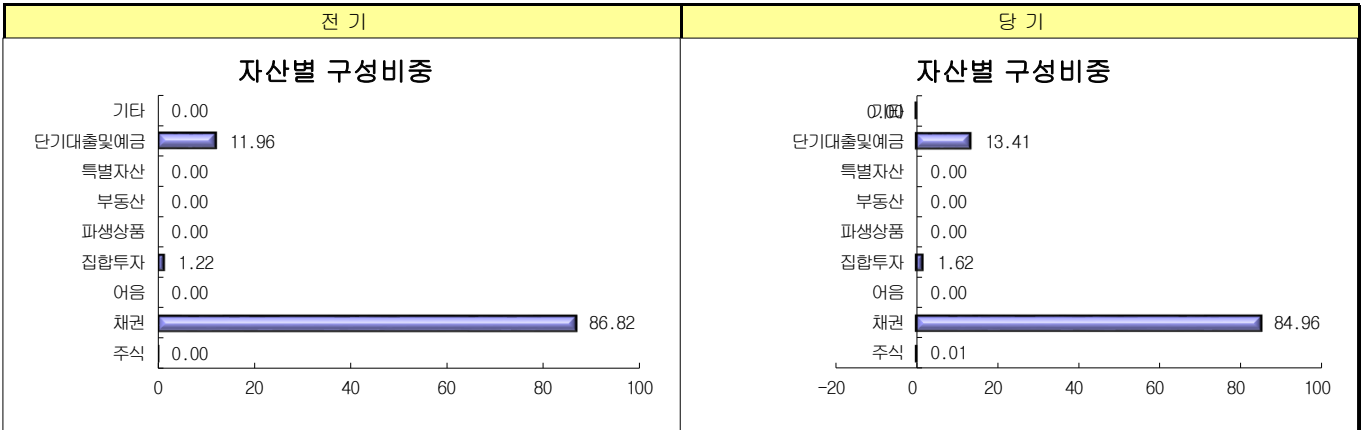
3. 자산현황

▶ **자산구성현황**

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	12	105,486	0	2,006	0	0	0	0	0	16,649	0	124,153
(0.00)	(0.01)	(84.96)	(0.00)	(1.62)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(13.41)	(0.00)	(100.00)
합 계	12	105,486	0	2,006	0	0	0	0	0	16,649	0	124,153

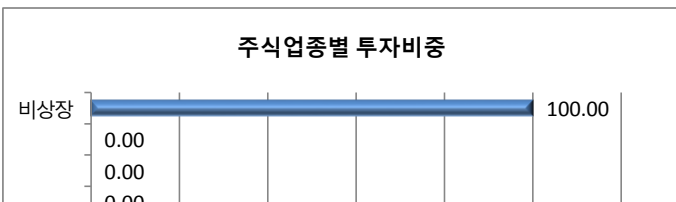
* () : 구성 비중

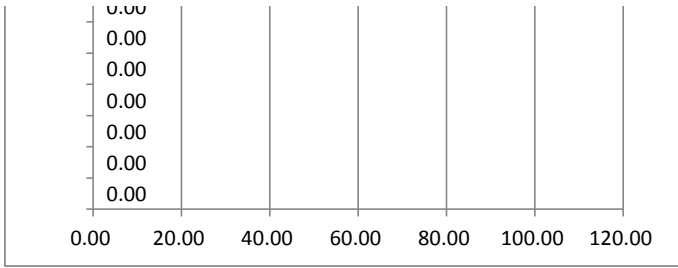


▶ **주식업종별 투자비중**

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	비상장	100.00	6		0.00
2			7		
3			8		
4			9		
5			10		





▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	채권	통안0164-1902-02	6	채권	통안0146-1804-02
2	채권	통안0125-1808-02	7	채권	한국철도시설채권287
3	단기상품	REPO매수(20170223)	8	채권	통안0133-1810-02
4	채권	토지주택채권182	9	단기상품	REPO매수(20170223)
5	채권	예보기금특별계정채권2015-0	10	채권	국고02750-1909(14-4)

※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
통안0164-1902-02	20,000	20,033	대한민국	KRW	2017-02-02	2019-02-02		N/A	16.14
통안0125-1808-02	20,000	19,931	대한민국	KRW	2016-08-02	2018-08-02		N/A	16.05
토지주택채권182	10,000	10,156	대한민국	KRW	2013-02-07	2018-02-07		AAA	8.18
예보기금특별계정채권2015	10,000	10,110	대한민국	KRW	2015-09-03	2018-09-03		AAA	8.14
통안0146-1804-02	10,000	10,020	대한민국	KRW	2016-04-02	2018-04-02		N/A	8.07
한국철도시설채권287	10,000	10,014	대한민국	KRW	2016-11-10	2019-11-10		AAA	8.07
통안0133-1810-02	10,000	9,981	대한민국	KRW	2016-10-02	2018-10-02		N/A	8.04
국고02750-1909(14-4)	3,000	3,118	대한민국	KRW	2014-09-10	2019-09-10		N/A	2.51

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
REPO매수	한국자금중개	2017-02-23	4,650	0.01		대한민국	KRW
REPO매수	서울외국환중개	2017-02-23	12,561	0.01		대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력

(단위 : 개, 억)

성명	직위	출생년도	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
채경섭	주식 책임운용역	1974	10	1,027	-	-	2109000941
김지상	주식 부책임운용역	1985	9	616	-	-	2115000373
정승호	채권 책임운용역	1975	11	742	-	-	2110000746

▶ 운용전문인력 최근 변경 내역

운용전문인력	직위	운용기간
김지상	부책임용역	2016.01.04~현재

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구 분	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**	3	0.00	2	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	9	0.01	2	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	9	0.01	2	0.00
	증권거래세	22	0.01	1	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)A	자산운용사	75	0.08	61	0.08	
	판매회사	88	0.09	71	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	5	0.01	4	0.01	
	일반사무관리회사	4	0.00	3	0.00	
	보수합계	171	0.17	138	0.17	
	기타비용**	2	0.00	2	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	5	0.01	1	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	5	0.01	1	0.00
	증권거래세	12	0.01	1	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)Ae	자산운용사	3	0.08	3	0.08	
	판매회사	2	0.04	1	0.04	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	5	0.13	4	0.13	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.01	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.01	0	0.00
	증권거래세	1	0.01	0	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)C	자산운용사	55	0.08	39	0.08	
	판매회사	109	0.15	78	0.15	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	4	0.01	3	0.01	
	일반사무관리회사	3	0.00	2	0.00	
	보수합계	170	0.24	122	0.24	
	기타비용**	2	0.00	1	0.00	
	매매. 중개 수수료	단순매매.중개수수료	4	0.01	1	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	4	0.01	1	0.00
	증권거래세	9	0.01	0	0.00	
단기국공채공모주1(채훈)Ce	자산운용사	4	0.08	2	0.08	
	판매회사	4	0.08	2	0.08	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	8	0.16	4	0.16	
	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	1	0.01	0	0.00
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	자산운용사		0	0.08	0	0.08
	판매회사		0	0.09	1	0.09
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		1	0.17	1	0.17
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.01	0	0.00
조사분석업무 등 서비스 수수료		0	0.00	0	0.00	
합계		0	0.01	0	0.00	
		증권거래세	0	0.01	0	0.00
단기국공채공모주1(채훈)C-W	자산운용사		0	0.08	0	0.08
	판매회사		0	0.00	0	0.00
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		0	0.08	0	0.08
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매·중개수수료	단순매매·중개수수료	0	0.01	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.01	0	0.00
			증권거래세	0	0.01	0

* 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	0.0098	0.0215	0.0313
	당기	0.0078	0.0141	0.0219
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	전기	0.6971	0.0148	0.7119
	당기	0.696	0.0119	0.7079
단기국공채공모주1(채훈)Ae	전기	0.5167	0.0148	0.5315
	당기	0.5154	0.0118	0.5272
단기국공채공모주1(채훈)C	전기	0.9484	0.0146	0.963
	당기	0.9466	0.012	0.9586
단기국공채공모주1(채훈)Ce	전기	0.6467	0.0139	0.6606
	당기	0.6457	0.012	0.6577
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	전기	0.696	0.0154	0.7114
	당기	0.6953	0.011	0.7063
단기국공채공모주1(채훈)C-W	전기	0.3413	0.0159	0.3572
	당기	0.3422	0.0119	0.3541

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(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	13,289	304	792.60	3144.54
---	---	--------	-----	--------	---------

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

16년05월24일 ~16년08월23일	16년08월24일 ~16년11월23일	16년11월24일 ~17년02월23일
398.71	1,034.20	792.60

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