

자산운용보고서

마이다스 단기극공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용)

(운용기간 : 2019.02.24 ~ 2019.05.23)

○ 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률이하 자본시장법에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

마이다스에셋자산운용

서울시 종로구 경희궁길 20

(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
 - ▶ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
4. 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
 - ▶ 해외 운용 수탁회사
5. 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
6. 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 주식 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-Pe2 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-W 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)Ce		5등급	AX668 AX669 AX670 AX671 B8572 BU380 BB697 AX672
펀드의 종류	혼합채권형, 추가형, 종류형	최초설정일	2014.11.24
운용기간	2019.02.24 ~ 2019.05.23	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	신한은행
판매회사	기업은행, 신한은행, 우리은행, 키움증권	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)	23,130	31,267	35.18
	부채총액(B)	60	35	-41.54
	순자산총액(C=A-B)	23,070	31,232	35.38
	발행 수익증권 총 수(D)	21,858	29,262	33.87
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,055.46	1,067.34	1.13
종류(Class)별 기준가격 현황				
단기국공채공모주1(채혼)A	기준가격	1,026.25	1,036.08	0.96
단기국공채공모주1(채혼)Ae	기준가격	1,026.73	1,037.01	1.00
단기국공채공모주1(채혼)C	기준가격	1,025.59	1,034.78	0.90
단기국공채공모주1(채혼)Ce	기준가격	1,026.38	1,036.33	0.97
단기국공채공모주1(채혼)C-P2	기준가격	1,023.98	1,033.78	0.96
단기국공채공모주1(채혼)C-W	기준가격	1,023.55	1,034.23	1.04
단기국공채공모주1(채혼)C-Pe2	기준가격	1,020.93	1,031.17	1.00

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

펀드 수익률은 A 클래스 기준 0.96%로 비교지수 대비 0.76%p 높은 성과를 기록했습니다. 당 기간의 공모주 투자 관련 운용경과는 다음과 같습니다. 3월에 신규 상장된 총 7개의 종목(2월 수요예측 3건 포함) 중펀드는 5개 종목에 대한 물량을 확보하였고, 각 종목의 상장일에 전량 매도하였습니다.이 종목들은 상장 당일 시초가가 공모가를 상회하여 펀드의 수익에 긍정적으로 기여하였습니다. 이 중 펀드내 1.32% 비중으로 편입하였던 드림텍은 공모가 대비 33.62%의 수익을 얻어 펀드의 수익률에 크게 기여하였습니다(기여수익률: 0.42%). 한편, 에코프로비엠, 미래에셋벤처투자, 이지케어텍의 경우 종목 수익률은 양호하였으나,투자의 비중이 크지 않아 펀드 내 기여수익률은 0.01%~0.02% 수준이었습니다. 지노믹트리는 종목의 수익률과 투자의 비중이 모두 크지 않아 펀드 내 기여수익률도 제한적이었습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

5월에는 5개의 종목이 수요예측을 진행하였으며 3개의 종목이 신규 상장되었습니다(스팩 제외). 5월에 상장한 종목 3건 중 2건(SNK(4월 수요예측), 수젠텍)은 상장 당일공모가를 하회하는 시초가를 형성하였으며, 1건(컴퍼니케이)은 상장 당일 시초가가 공모가를 상회하여, 종목별로 상이한 모습을 보였습니다.

▶기간(누적) 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	1.13	2.99	3.95	4.30
(비교지수 대비 성과)	(0.93)	(1.87)	(2.95)	(3.01)
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	0.96	2.64	3.42	3.59
(비교지수 대비 성과)	(0.76)	(1.52)	(2.42)	(2.30)
단기국공채공모주1(채훈)Ae	1.00	2.73	3.56	3.78
(비교지수 대비 성과)	(0.80)	(1.61)	(2.56)	(2.49)
단기국공채공모주1(채훈)C	0.90	2.51	3.23	3.33
(비교지수 대비 성과)	(0.70)	(1.39)	(2.23)	(2.04)
단기국공채공모주1(채훈)Ce	0.97	2.67	3.46	3.64
(비교지수 대비 성과)	(0.77)	(1.55)	(2.46)	(2.35)
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	0.96	2.64	3.42	3.59
(비교지수 대비 성과)	(0.76)	(1.52)	(2.42)	(2.30)
단기국공채공모주1(채훈)C-W	1.04	2.82	3.70	3.95
(비교지수 대비 성과)	(0.84)	(1.70)	(2.70)	(2.66)
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	1.00	2.76	3.67	-
(비교지수 대비 성과)	(0.80)	(1.64)	(2.67)	-
비교지수(벤치마크)	0.20	1.12	1.00	1.29

주)비교지수(벤치마크): 국공채 1년-1년6개월 X 90% + KOSPI X 5% + CALL X 5%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	4.30	5.96	7.70	-
(비교지수 대비 성과)	(3.01)	(2.73)	(2.00)	-
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	3.59	4.52	5.50	-
(비교지수 대비 성과)	(2.30)	(1.29)	(-0.20)	-
단기국공채공모주1(채훈)Ae	3.78	4.89	6.07	-
(비교지수 대비 성과)	(2.49)	(1.66)	(0.37)	-
단기국공채공모주1(채훈)C	3.33	4.00	4.72	-
(비교지수 대비 성과)	(2.04)	(0.77)	(-0.98)	-
단기국공채공모주1(채훈)Ce	3.64	4.62	5.66	-
(비교지수 대비 성과)	(2.35)	(1.39)	(-0.04)	-
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	3.59	4.52	5.50	-
(비교지수 대비 성과)	(2.30)	(1.29)	(-0.20)	-
단기국공채공모주1(채훈)C-W	3.95	5.25	6.62	-
(비교지수 대비 성과)	(2.66)	(2.02)	(0.92)	-
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	1.29	3.23	5.70	0.00

주)비교지수(벤치마크): 국공채 1년-1년6개월 X 90% + KOSPI X 5% + CALL X 5%

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

▶ 손익현황

(단위: 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	226	82	0	9	0	0	0	0	0	15	0	330
당기	122	117	0	9	0	0	0	0	0	31	-1	278

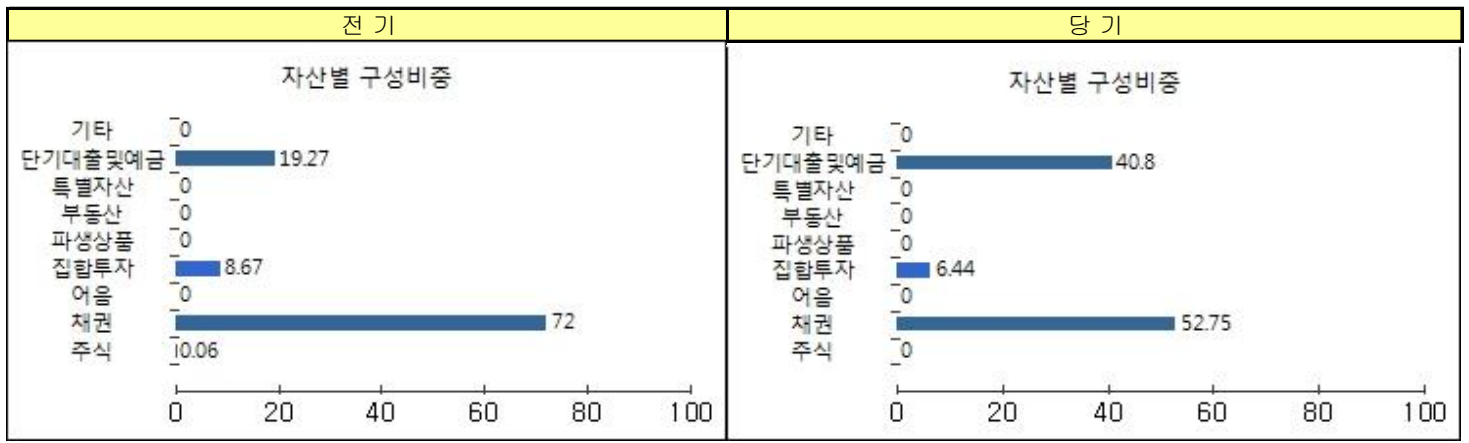
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	0	16,495	0	2,015	0	0	0	0	0	12,758	0	31,267
(1.00)	(0.00)	(52.75)	(0.00)	(6.44)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(40.80)	(0.00)	(100.00)
합계	0	16,495	0	2,015	0	0	0	0	0	12,758	0	31,267

* (단위): 구성비중



▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	대한민국	100			

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

순위	구분	종목명	비중	순위	구분	종목명	비중
1	채권	통안01930-2012-02	32.24	6	단기상품	REPO매수(20190523)	8.00
2	채권	국고02000-2112(18-9)	20.51	7	집합투자증권	KODEX 단기채권	6.44
3	단기상품	REPO매수(20190523)	8.96	8	단기상품	은대	4.98
4	단기상품	REPO매수(20190523)	8.96	9	단기상품	REPO매수(20190523)	0.96
5	단기상품	REPO매수(20190523)	8.96				

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안01930-2012-02	10,000	10,082	대한민국	KRW	2018-12-02	2020-12-02		N/A	32.24
국고02000-2112(18-9)	6,300	6,413	대한민국	KRW	2018-12-10	2021-12-10		N/A	20.51

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

▶ 집합투자증권

(단위: 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KODEX 단기채권	수익증권	삼성자산운용	2,031	2,015	대한민국	KRW	6.44

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	미래에셋자산운용(Repo)	2019-05-23	2,800	1.79		대한민국	KRW
REPO매수	NH투자증권	2019-05-23	2,800	1.77		대한민국	KRW
REPO매수	유안타증권	2019-05-23	2,800	1.72		대한민국	KRW
REPO매수	동양투신운용	2019-05-23	2,500	1.79		대한민국	KRW
예금	신한은행	2014-11-24	1,557	1.38		대한민국	KRW
REPO매수	동양투신운용	2019-05-23	300	1.79		대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 백만원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
김민수 ㉠	차장	38	2	38,018	0		2111000836
김지상	과장	35	9	63,519	0		2115000373

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임투자운용인력이며, '책임투자운용인력'이란 투자운용인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함.

※ 펀드의 투자운용인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. (인터넷 주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 현회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이 할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2016.08.25 ~ 현재 2018.03.16 ~ 현재 2014.11.24 ~ 2018.05.28 2014.11.24 ~ 2018.03.15 2016.01.08 ~ 2018.05.28	김지상 김민수 채경섭 정승호 강경식

▶ 해외운용수탁회사

회사명	소재	국가명	비고
해당사항 없음			

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}	
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 ^{주2)}	0	0.00	0	0.00	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1	0.00	1	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.00	0	0.00
		합계	1	0.01	1	0.00
	증권거래세	3	0.01	1	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)A	자산운용사	7	0.08	8	0.07	
	판매회사	8	0.09	9	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	1	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	15	0.17	18	0.17	
	기타비용 ^{주2)}	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	1	0.01	0	0.00
	증권거래세	1	0.02	1	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)Ae	자산운용사	1	0.08	1	0.07	
	판매회사	0	0.04	0	0.04	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	1	0.13	1	0.12	
	기타비용 ^{주2)}	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	0.01	0	0.00
	증권거래세	0	0.01	0	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)C	자산운용사	6	0.08	7	0.07	
	판매회사	11	0.15	15	0.15	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	18	0.24	23	0.23	
	기타비용 ^{주2)}	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	1	0.01	1	0.01	

단기국공채공모주1(채훈)Ce	자산운용사		1	0.08	1	0.07	
	판매회사		1	0.08	1	0.07	
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00	
	보수합계		1	0.16	1	0.15	
	기타비용 ^{주2)}		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	0.01	0	0.00
	증권거래세		0	0.01	0	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	자산운용사		1	0.08	1	0.07	
	판매회사		1	0.09	1	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00	
	보수합계		2	0.17	3	0.17	
	기타비용 ^{주2)}		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	0.01	0	0.00
	증권거래세		0	0.02	0	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)C-W	자산운용사		0	0.08	0	0.07	
	판매회사		0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00	
	보수합계		0	0.08	0	0.08	
	기타비용 ^{주2)}		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	0.01	0	0.00
	증권거래세		0	0.02	0	0.01	
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	자산운용사		0	0.07	0	0.07	
	판매회사		0	0.04	0	0.04	
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00	
	보수합계		0	0.13	0	0.12	
	기타비용 ^{주2)}		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	0.01
	증권거래세		0	0.00	0	0.01	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율을 나타냅니다.

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

※ 성과보수내역 : 해당 없음

※ 발행분담금내역 : 해당 없음

▶ 총보수, 비용비율

(단위: 연환산,%)

	구분	총보수·비용비율(A) ^{주1)}	매매·중개수수료비율(B) ^{주2)}	합계(A+B)
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	전기	0.0025	0.0216	0.0241
	당기	0.0019	0.0227	0.0246
단기국공채공모주1(채훈)A	전기	0.6901	0.0219	0.712
	당기	0.6892	0.0237	0.7129
단기국공채공모주1(채훈)Ae	전기	0.5096	0.0223	0.5319
	당기	0.5091	0.0233	0.5324
단기국공채공모주1(채훈)C	전기	0.94	0.0204	0.9604
	당기	0.9397	0.0209	0.9606
단기국공채공모주1(채훈)Ce	전기	0.6394	0.0224	0.6618
	당기	0.6389	0.0233	0.6622
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	전기	0.689	0.0237	0.7127
	당기	0.6888	0.0239	0.7127
단기국공채공모주1(채훈)C-W	전기	0.3381	0.0234	0.3615
	당기	0.3378	0.0238	0.3616
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	전기	0.4922	0.0082	0.5004
	당기	0.5072	0.0195	0.5267

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, %)

단기국공채공모주1(채환)(운용)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	25,994	458	1001.59	4107.65

주) 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율입니다. 매매회전율이 높을경우 매매거래수수료(0.1% 내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 주식 매매회전율 추이

(단위: %)

단기국공채공모주1(채환)(운용)

2018-08-24 ~ 2018-11-23	2018-11-24 ~ 2019-02-23	2019-02-24 ~ 2019-05-23
961.51	1539.62	1001.59

7. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

▶ 고유재산 투자에 관한 사항

(단위: 원, %)

펀드명	투자시기	투자금액	수익률	비고
해당사항 없음				

주1) 수익률은 분기운용보고서 말일 기준

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 신한은행의 확인을 받아 한국예탁결제원을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용(주)
금융투자협회

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

02-3787-3500