

자산운용보고서

마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)(운용)

(운용기간 : 2019.07.30 ~ 2019.10.29)

○ 자산운용보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 자본시장법)에 의거 자산운용회사가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(6개월) 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 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)(운용)		6등급	CK138
마이다스 우량채권 증권 모두자신탁(채권)			53840
마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)A			CK139
마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)Ae			CK140
마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)C			CK141
마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)C-P1			CK143
마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)C-Pe1			CK144
마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)C-Pe2			CK146
마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)Ce			CK142
마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)S-P		CV514	
펀드의 종류	채권형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2019.07.30
운용기간	2019.07.30 ~ 2019.10.29	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	KEB하나은행
판매회사	DB금융투자, KB증권, 교보증권, 기업은행, 유진투자증권, 키움증권, 하나금융투자, 한국투자증권, 한국포스증권, 현대차투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	이 투자신탁은 자산의 대부분을 국내 우량채권에 주로 투자하는 모집합투자기구의 집합투자증권에 투자하며, 이를 통하여 이자소득과 자본소득을 추구함을 목적으로 합니다.		

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
우량채권자(채권)(운용)	자산 총액(A)		4,146	0.00
	부채총액(B)			0.00
	순자산총액(C=A-B)		4,146	0.00
	발행 수익증권 총 수(D)		4,146	0.00
	기준가격 (E=C/Dx1000)	0.00	1,000.02	0.00
종류(Class)별 기준가격 현황				
우량채권자(채권)A	기준가격	0.00	999.25	-0.08
우량채권자(채권)Ae	기준가격	0.00	999.40	-0.06
우량채권자(채권)C	기준가격	0.00	998.98	-0.10
우량채권자(채권)C-P1	기준가격	0.00	996.89	-0.31
우량채권자(채권)C-Pe1	기준가격	0.00	998.50	-0.15
우량채권자(채권)C-Pe2	기준가격	0.00	997.62	-0.24
우량채권자(채권)Ce	기준가격	0.00	999.36	-0.06
우량채권자(채권)S-P	기준가격	0.00	1,000.60	0.06

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 A클래스 기준 -0.08%로 비교지수 대비 0.14%p 낮은 수준을 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

10월 국내 채권시장은 국고채 3년 금리가 전월 대비 0.165%p 상승한 1.462%로 마감하며약세 흐름을 보였습니다. 미중 고위급 무역협상 진전 및 하드 브렉시트 발생 가능성 감소 등대외 리스크 요인이 감소함에 따라 안전자산 선호 심리가 약화되었습니다. 또한, 한국은행은 10월 금융통화위원회에서 기준금리를 1.25%로 0.25%p 인하하였으나, 시장의 예상과 달리금통위원 2인이 기준금리 동결을 주장함에 따라 금리의 추가 인하 기대감이 약화되었습니다. 11월 국내 채권시장은 박스권 장세를 전망합니다(국고 3년 1.45%~1.65%). 현재 시장금리는 기준금리 대비 투자 매력에 있는 것으로 판단하나, 적자국채 발행 예고에 따른 수급 부담및 경기 저점 인식에 대한 기대감 등으로 당분간 변동성 장세를 보일 것으로 판단합니다.

▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
우량채권자(채권)(운용)	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.06)	-	-	-

종류(Class)별 현황				
우량채권자(채권)A	-0.08	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.14)	-	-	-
우량채권자(채권)Ae	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)C	-0.10	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.16)	-	-	-
우량채권자(채권)C-P1	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)C-Pe1	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)C-Pe2	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)Ce	-0.06	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.12)	-	-	-
우량채권자(채권)S-P	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률	-0.10	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.16)	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.06	0.00	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): KIS 중단기지수(1-2Y) X 55% + KIS 중기지수(2-3Y) X 40% + CALL X 5%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
우량채권자(채권)(운용)	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
우량채권자(채권)A	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)Ae	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)C	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)C-P1	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)C-Pe1	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)C-Pe2	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)Ce	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
우량채권자(채권)S-P	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률	-	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
비교지수(벤치마크)	0.00	0.00	0.00	0.00

주)비교지수(벤치마크): KIS 중단기지수(1-2Y) X 55% + KIS 중기지수(2-3Y) X 40% + 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	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0
당기	0	-8	1	0	0	0	0	0	0	-1	0	-7

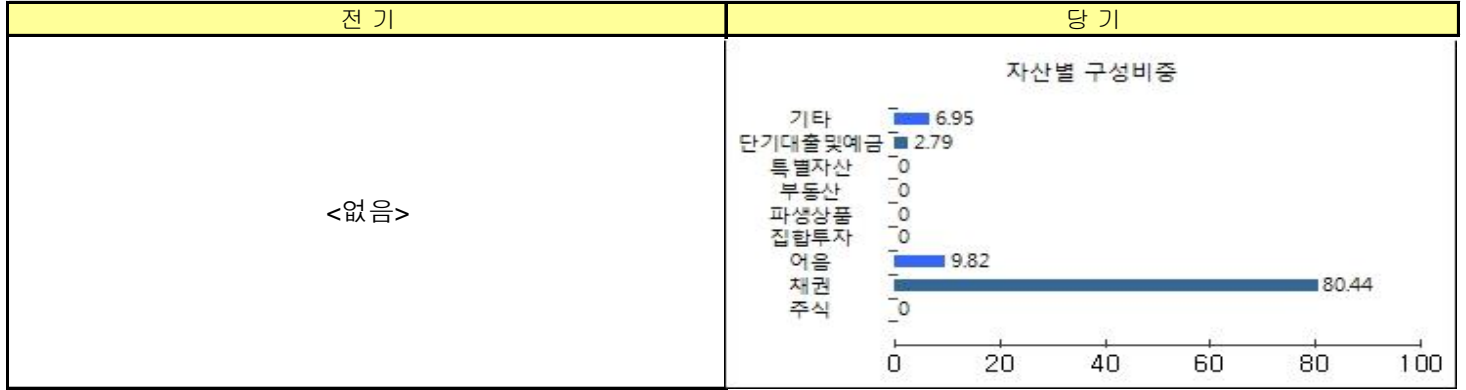
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW (1.00)	0 (0.00)	3,335 (80.44)	407 (9.82)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	115 (2.79)	288 (6.95)	4,146 (100.00)
합계	0	3,335	407	0	0	0	0	0	0	115	288	4,146

* (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	국고01875-2203(16-10)	9.95	6	채권	케이비국민카드230-1	9.78
2	채권	신한은행23-06-이-3-C	9.85	7	채권	GS건설136	4.92
3	채권	신한은행23-06-이-3-B	9.85	8	어음	CP(현대오일뱅크 20190927-91-125)	4.91
4	채권	하나캐피탈289-1	9.85	9	어음	CP(현대오일뱅크 20190927-91-124)	4.91
5	채권	한국남부발전36-1	9.83	10	채권	태영건설66	4.91

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
국고01875-2203(16-10)	408	413	대한민국	KRW	2017-03-10	2022-03-10		N/A	9.95
신한은행23-06-이-3-C	408	409	대한민국	KRW	2019-06-19	2022-06-19		AAA	9.85
신한은행23-06-이-3-B	408	408	대한민국	KRW	2019-06-14	2022-06-14		AAA	9.85
하나캐피탈289-1	408	408	대한민국	KRW	2019-09-05	2021-03-05		AA-	9.85
한국남부발전36-1	408	407	대한민국	KRW	2016-09-06	2021-09-06		AAA	9.83
케이비국민카드230-1	400	405	대한민국	KRW	2018-01-26	2021-04-26		AA+	9.78
GS건설136	204	204	대한민국	KRW	2019-07-12	2022-07-12		A0	4.92
태영건설66	204	203	대한민국	KRW	2019-07-23	2022-07-22		A0	4.91

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

▶ 어음

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
CP(현대오일뱅크 20190927-91-124)	204	204	2019-09-27	2019-12-27		A1	4.91
CP(현대오일뱅크 20190927-91-125)	204	204	2019-09-27	2019-12-27		A1	4.91

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	
박정환	대표	56	11	159,574	4	32,294	2109000201
김민수	차장	38	2	56,268			2111000836

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
2019.07.30 ~ 현재 2019.07.30 ~ 현재	박정환 김민수

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급 현황

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율 ^{주1)}	금액	비율 ^{주1)}	
우량채권자(채권)(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	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.00	0	0.00	
우량채권자(채권)A	자산운용사	0	0.00	0	0.02	
	판매회사	0	0.00	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	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	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.00	0	0.00	
우량채권자(채권)Ae	자산운용사	0	0.00	0	0.02	
	판매회사	0	0.00	0	0.02	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.05	
	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	0	0.00	0	0.00	
우량채권자(채권)C	자산운용사	0	0.00	1	0.02	
	판매회사	0	0.00	2	0.08	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	3	0.10	
	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	0	0.00	0	0.00	

우량채권자(채권)C-P1	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	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.00	0	0.00	
우량채권자(채권)C-Pe1	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	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.00	0	0.00	
우량채권자(채권)C-Pe2	자산운용사	0	0.00	0	0.01	
	판매회사	0	0.00	0	0.02	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.03	
	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	0	0.00	0	0.00	
우량채권자(채권)Ce	자산운용사	0	0.00	0	0.02	
	판매회사	0	0.00	0	0.04	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.07	
	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	0	0.00	0	0.00	
우량채권자(채권)S-P	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	0	0.00	0	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.00	0	0.00
	증권거래세	0	0.00	0	0.00	

* 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)
우량채권자(채권)(운용)	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.0073	0.0093	0.0166
우량채권자(채권)A	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.3168	0.0102	0.3270
우량채권자(채권)Ae	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.1992	0.0080	0.2072

우량채권자(채권)C	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.4197	0.0093	0.4290
우량채권자(채권)C-P1	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.0074	0.0104	0.0178
우량채권자(채권)C-Pe1	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.0072	0.0046	0.0118
우량채권자(채권)C-Pe2	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.1913	0.0096	0.2009
우량채권자(채권)Ce	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.2666	0.0089	0.2755
우량채권자(채권)S-P	전기	0.0000	0.0000	0.0000
	당기	0.0065	0.0006	0.0071

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		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	0	0	0.00	0.00

주) 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 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 매매회전을 추이

2019.07.30~2019.10.29	-	-
해당사항 없음		

7. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

▶ 고유재산 투자에 관한 사항

(단위: 원, %)

펀드명	투자시기	투자금액	수익률	비고
우량채권증권자1호(채권) C	2019-07-30	1,000,000,000	-0.10	판매사: 기업은행
합계	-	1,000,000,000	-	-

주1) 수익률은 분기운용보고서 말일 기준

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 우량채권 증권 자투자신탁 제1호(채권)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 KEB하나은행의 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