

자산운용보고서

마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용)

(운용기간 : 2021.03.18 ~ 2021.06.17)

○자산운용 보고서는 자본시장과 금융투자업에 관한 법률(이하 '자본시장법')에 의거 자산운용회사가 작성하며 투자자가 가입한 상품의 특
정기간(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

펀드명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용), 마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)A1, 마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)Ae, 마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)C3, 마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)C5		2등급	34270, 71281, BS191, 28691, 28693
펀드의 종류	주식형, 추가형, 종류형	최초설정일	2002.04.19
운용기간	2021.03.18 ~ 2021.06.17	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	마이다스에셋자산운용	펀드재산보관회사	국민은행(유추열)
판매회사	KB증권, NH투자증권, 교보생명보험, 교보증권, 국민은행, 대신증권, 미래에셋증권, 발기자본금, 삼성증권, 스탠다드차타드은행, 신한금융투자, 신한은행, 하나금융투자, 하나은행, 하이투자증권, 한국씨티은행, 한국투자증권, 한국포스증권, 한화투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	주식은 적극적인 운용으로 주식시장 이상의 수익을 추구하는 주식 운용과 함께, 현재 주가보다 높은 행사가격의 콜옵션을 매도하는 커버드콜 전략으로 옵션프리미엄을 축적, 주가하락위험을 줄이면서 추가수익을 추구합니다.		

▶ 자산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
커버드콜MF(주식)(운용)	자산 총액(A)	2,725	2,411	-11.50
	부채총액(B)	38	10	-73.51
	순자산총액(C=A-B)	2,687	2,401	-10.62
	발행 수익증권 총 수(D)	2,245	2,265	0.89
	기준가격 (E=C/Dx1000)	1,196.83	1,060.25	6.03
종류(Class)별 기준가격 현황				
커버드콜MF(주식)A1	기준가격	1,152.93	1,057.03	5.70
커버드콜MF(주식)Ae	기준가격	1,313.47	1,057.73	5.77
커버드콜MF(주식)C3	기준가격	1,172.93	1,060.26	6.03
커버드콜MF(주식)C5	기준가격	1,065.39	1,055.74	5.57

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

펀드수익률은 A1클래스 기준 1.34%로, 참고 지표 대비 0.01%p 낮은 수준을 기록했습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

5월 KOSPI는 6개월 연속 상승 이후 상승폭이 둔화되긴 했으나, 월간으로는 7개월 연속 강세가 지속되었습니다. 반면, KOSDAQ은 3개월 만에 다시 하락 전환하며 0.2% 하락한 981.8pt에 마감하였습니다.

업종별로는 KOSPI 22개 업종 중 16개 업종이 상승한 가운데, 음식료품(+12.1%), 기계(+11.8%), 은행(+11.4%) 업종의 상승 폭이 두드러졌습니다.

국내 증시는 1) 기저효과로 인한 물가지표 및 2) 실물지표의 일시적인 괴리에 투자심리가 영향받을 가능성을 유의할 필요가 있다고 보이며 월간으로는 7개월 연속 상승으로 인한 피로감과 그에 비해 추가 상승 재료가 점차 소진되어 가는 중이라 판단되어 중립 이하의 흐름이 전망됩니다. 6월 FOMC가 다가오며 금융시장 변동성이 확대될 가능성이 있는 가운데 통화정책, 재정정책, 실적 등 주식시장의 추가 상승 재료가 소진되고 이에 따라 모멘텀이 약화될 가능성이 높아질 것으로 판단합니다. KOSPI 12개월 예상 PER은 11.5배로 이익 추정치 상황이 지속되고 있고 7.1% 성장 전망되는 2022년 순이익 반영되면서 밸류에이션 부담은 완화된 상황으로 KOSPI 지수 하단을 지지하는 역할을 할 것으로 보여 증시를 둘러싼 매크로 환경의 악재에도 불구하고 지수 급락 가능성은 낮다고 판단합니다.

그간 단기 상승폭 및 펀드 내 편입 비중이 높았던 자동차 업종의 비중을 축소할 계획입니다. 반면, 경기 정상화에 대한 기대는 여전히 유효하다고 판단하여 화학, 정유, 철강 등 경기민감 업종과 밸류에이션 매력에 높아진 2차전지, 친환경 에너지 등의 업종에 대한 비중은 확대할 예정입니다.

▶ 기간(누적) 수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
커버드콜MF(주식)(운용)	6.03	13.41	26.03	38.10
(비교지수 대비 성과)	(0.65)	(0.02)	(-0.15)	(0.21)
종류(Class)별 현황				
커버드콜MF(주식)A1	5.70	12.72	24.91	36.46
(비교지수 대비 성과)	(0.32)	(-0.67)	(-1.27)	(-1.43)
커버드콜MF(주식)Ae	5.77	12.86	25.14	36.79
(비교지수 대비 성과)	(0.39)	(-0.53)	(-1.04)	(-1.10)
커버드콜MF(주식)C3	6.03	13.41	26.02	38.09
(비교지수 대비 성과)	(0.65)	(0.02)	(-0.16)	(0.20)
커버드콜MF(주식)C5	5.57	12.44	24.46	35.80
(비교지수 대비 성과)	(0.19)	(-0.95)	(-1.72)	(-2.09)
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률	5.57	12.44	24.46	35.81
(비교지수 대비 성과)	(0.19)	(-0.95)	(-1.72)	(-2.08)
비교지수(벤치마크)	5.38	13.39	26.18	37.89

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 75% + CD91 X 25%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
커버드콜MF(주식)(운용)	38.10	49.29	31.06	48.05
(비교지수 대비 성과)	(0.21)	(7.50)	(2.57)	(-3.54)
종류(Class)별 현황				
커버드콜MF(주식)A1	36.46	45.66	26.27	39.17
(비교지수 대비 성과)	(-1.43)	(3.87)	(-2.22)	(-12.42)
커버드콜MF(주식)Ae	36.79	46.39	-	-
(비교지수 대비 성과)	(-1.10)	(4.60)	-	-
커버드콜MF(주식)C3	38.09	49.30	31.06	46.61
(비교지수 대비 성과)	(0.20)	(7.51)	(2.57)	(-4.98)
커버드콜MF(주식)C5	35.80	44.22	24.39	35.72
(비교지수 대비 성과)	(-2.09)	(2.43)	(-4.10)	(-15.87)
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률	44.22	44.22	24.39	35.73
(비교지수 대비 성과)	(-2.08)	(2.43)	(-4.10)	(-15.86)
비교지수(벤치마크)	37.89	41.79	28.49	51.59

주)비교지수(벤치마크): KOSPI X 75% + CD91 X 25%

※ 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	426	0	0	0	-151	0	0	0	0	0	-1	274
당기	122	0	0	0	29	0	0	0	0	0	-1	150

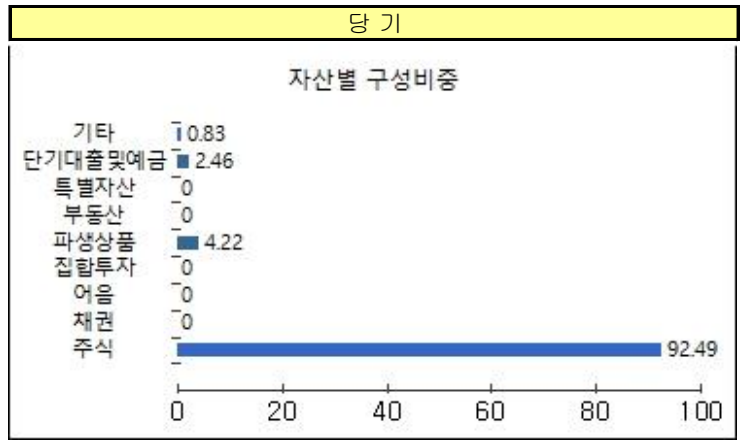
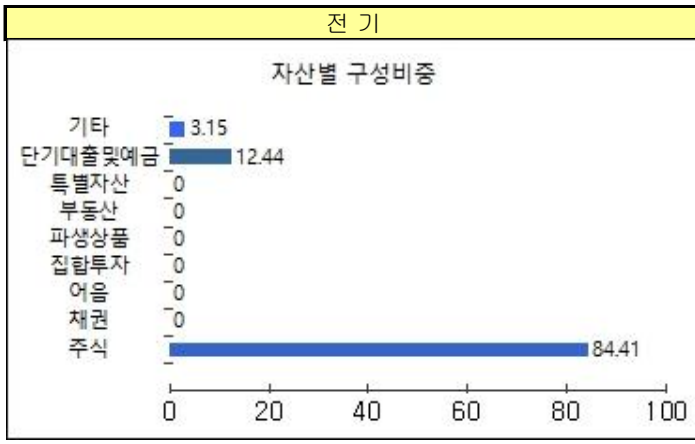
3. 자산현황

▶ 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)	2,230 (92.49)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	102 (4.22)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	59 (2.46)	20 (0.83)	2,411 (100.00)
합계	2,230	0	0	0	102	0	0	0	0	59	20	2,411

* (): 구성비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	전기전자	30.50	6	의약품	6.05
2	화학	11.57	7	유통업	4.48
3	서비스업	11.25	8	제조	4.38
4	운수장비	10.05	9	통신업	2.07
5	금융업	6.22	10	기타	13.43

▶ 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	주식	삼성전자	19.94	6	주식	카카오	2.82
2	단기상품	증거금(NH투자증권)	4.22	7	주식	LG화학	2.77
3	주식	SK하이닉스	4.02	8	주식	삼성바이오로직스	2.56
4	주식	현대차	3.15	9	단기상품	보통예금	2.46
5	주식	NAVER	3.04	10	주식	기아	2.40

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
삼성전자	5,945	481	19.9	대한민국	KRW	전기전자	
SK하이닉스	766	97	4.0	대한민국	KRW	전기전자	
현대차	321	76	3.2	대한민국	KRW	운수장비	
NAVER	188	73	3.0	대한민국	KRW	서비스업	
카카오	460	68	2.8	대한민국	KRW	서비스업	
LG화학	80	67	2.8	대한민국	KRW	화학	
삼성바이오로직스	74	62	2.6	대한민국	KRW	의약품	
기아	662	58	2.4	대한민국	KRW	운수장비	

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
증거금	NH투자증권		102	0.00		대한민국	KRW
예금	국민은행(유추일)	2004-01-12	59	0.10		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	
송형섭 ^{주)}	팀장	48	3	85,485	0		2109000914

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
2015.07.23 ~ 현재	송형섭

▶ 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)}	
커버드콜MF(주식)(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)}	2	0.05	1	0.05	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1	0.03	1	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	2	0.05	2	0.06
		합계	3	0.08	2	0.09
		증권거래세	5	0.15	3	0.12
커버드콜MF(주식)A1	자산운용사	5	0.16	4	0.16	
	판매회사	4	0.12	3	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.02	
	보수합계	10	0.31	7	0.31	
	기타비용 ^{주2)}	2	0.05	1	0.05	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	1	0.03	1	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	2	0.05	2	0.06
		합계	3	0.08	2	0.09
		증권거래세	5	0.15	3	0.12
커버드콜MF(주식)Ae	자산운용사	0	0.16	0	0.16	
	판매회사	0	0.06	0	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
	보수합계	0	0.24	0	0.25	
	기타비용 ^{주2)}	0	0.06	0	0.05	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.07
		합계	0	0.09	0	0.10
		증권거래세	0	0.15	0	0.12

커버드콜MF(주식)C3	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	0.05	0	0.05	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.06
		합계	0	0.08	0	0.09
	증권거래세	0	0.15	0	0.12	
커버드콜MF(주식)C5	자산운용사	0	0.16	0	0.16	
	판매회사	0	0.25	0	0.25	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.02	
	보수합계	0	0.43	0	0.44	
	기타비용(주2)	0	0.05	0	0.05	
	매매 중개 수수료	단순매매, 중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.06
		합계	0	0.08	0	0.09
	증권거래세	0	0.15	0	0.12	

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 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)
커버드콜MF(주식)(운용)	전기	0.1041	0.3589	0.463
	당기	0.1263	0.3613	0.4876
커버드콜MF(주식)A1	전기	1.3467	0.3594	1.7061
	당기	1.3687	0.3617	1.7304
커버드콜MF(주식)Ae	전기	1.1191	0.3625	1.4816
	당기	1.1441	0.3673	1.5114
커버드콜MF(주식)C3	전기	0.1243	0.3591	0.4834
	당기	0.1519	0.3624	0.5143
커버드콜MF(주식)C5	전기	1.8453	0.3633	2.2086
	당기	1.8675	0.3659	2.2334

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, %)

커버드콜MF(주식)(운용)

매수		매도		매매회전율 ^{주)}	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
37,370	1,057	29,725	1,254	54.33	215.55

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: %)

커버드콜MF(주식)(운용)

2020-09-18 ~ 2020-12-17	2020-12-18 ~ 2021-03-17	2021-03-18 ~ 2021-06-17
63.45	68.10	54.33

7. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

▶ 고유재산 투자에 관한 사항

(단위: 주(원), %)

펀드명	투자금액	수익률	비고
커버드콜MF	100,000,000	341.18	발기자본금(2002년 4월 19일 설정)

주1) 수익률은 분기운용보고서 말일 기준

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 커버드콜 증권 투자회사(주식)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 국민은행(유추얼)의 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

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모의 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용 시 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 223조 제3호 및 제4호)