

자산운용보고서

마이다스글로벌클린메타버스성장주증권투자신탁(H)(운용)

(운용기간 : 2022년12월27일 ~ 2023년03월26일)

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

마이다스에셋자산운용(주)

서울시 종로구 경희궁길 20
(/전화 02-3787-3500, <http://www.midasasset.com>)

목 차

- 1 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 자산현황
 - ▶ 펀드의 투자전략
- 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)
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전율
 - ▶ 최근 3분기 매매회전율 추이
- 7 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황
 - ▶ 투자현황
- 8 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안
 - ▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황
 - ▶ 나. 주요 위험 관리 방안
 - ▶ 다. 자전거래 현황
 - ▶ 라. 주요 비상대응계획
- 9 자산운용사의 고유재산 투자 및 회수에 관한 사항

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드	고난도 펀드
마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)(운용) 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)A 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)Ae 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)C 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)C-P1 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)C-P2 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)C-Pe1 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)C-Pe2 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)Ce 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)Cs 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)S 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)S-P 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권자투자신탁(H)S-R		2등급	DN135 DN136 DN137 DN138 DN141 DN147 DN143 DN164 DN139 DN339 DN167 DN171 DN172	해당하지 않음
펀드의 종류	투자신탁, 증권펀드(주식형), 개방형, 추가형, 종류형, 모자형	최초설정일	2021.09.27	
운용기간	2022.12.27 ~ 2023.03.26	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음	
투자소득의 과세	<집합투자기구> 집합투자기구 단계에서는 별도의 소득과세 부담이 없는 것이 원칙입니다. <연금지축계좌 가입자에 대한 과세> 소득세법 시행령 제40조의2에 따른 연금지축계좌를 통해 동 투자신탁에 가입한 가입자의 경우 동 투자신탁의 수익증권을 환매하는 시점에 별도의 과세를 하지 않으며, 연금지축계좌에서 자금 인출시 발생하는 연금소득(연금수령시), 기타소득 또는 퇴직소득(연금외수령시)에 대한 과세는 투자설명서 제2부 14. 이익 배분 및 과세에 관한 사항을 참고하시기 바랍니 다.			
자산운용회사	마이다스에셋자산운용(주)	펀드재산보관회사	하나은행	
판매회사	KB증권, 교보증권, 대신증권, 키움증권, 하나증권, 한국포스 증권, 현대차증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스	
상품의 특징	모투자신탁에 신탁재산의 90% 이상을 투자하는 자투자신탁으로 모투자신탁은 글로벌 증권시장에 상장된주식에 주로 투 자하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 모투자신탁은 클린어스(Clean Earth) 및 메타버스(MetaVerse)에 관련된 글로벌 주식을 주된 투자대상으로 하고, 신탁재산의 60% 이상을 글로벌 주식에 투자합니다.			

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
클린메타버스자(H)(운용)	자산 총액 (A)	2,903	3,047	4.98
	부채 총액 (B)	0	0	2.87
	순자산총액 (C=A-B)	2,903	3,047	4.98
	발행 수익증권 총 수 (D)	4,408	4,405	-0.08
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	658.48	691.84	5.07
종류(Class)별 기준가격 현황				
클린메타버스자(H)A	기준가격	644.88	674.86	4.65
클린메타버스자(H)Ae	기준가격	643.71	674.29	4.75
클린메타버스자(H)C	기준가격	643.06	672.55	4.59
클린메타버스자(H)C-P1	기준가격	643.44	673.11	4.61
클린메타버스자(H)C-P2	기준가격	644.13	673.99	4.64
클린메타버스자(H)C-Pe1	기준가격	647.16	677.74	4.73
클린메타버스자(H)C-Pe2	기준가격	647.31	677.98	4.74
클린메타버스자(H)Ce	기준가격	646.66	677.14	4.71
클린메타버스자(H)Cs	기준가격	650.29	681.66	4.82
클린메타버스자(H)S	기준가격	645.33	676.07	4.76
클린메타버스자(H)S-P	기준가격	635.60	665.98	4.78

클린메타버스자(H)S-R	기준가격	635.05	665.42	4.78
---------------	------	--------	--------	------

주) 기준가격이란 투자자가 집합투자증권을 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령 시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산 총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

▶ 펀드의 투자전략

1. 투자전략

이 투자신탁은 투자신탁재산의 60% 이상을 국내 주식을 포함한 글로벌 주식에 주로 투자하는 모투자신탁에 투자하여 자본이득 및 이자수익을 추구합니다. 또한, 모투자신탁의 운용실적에 따른 손익에 따라 이익 또는 손실이 발생합니다. 신탁재산의 60% 이상을 국내 주식을 포함한 글로벌 주식에 투자합니다. 이 투자신탁의 투자대상 국가는 미국, 일본, 중국, 한국, 유럽 등이며, 클린어스와 메타버스 테마 관련 주식에 주로 투자할 계획입니다. 또한, 주식 외에 클린어스 및 메타버스와 관련한 다양한 ETF(상장지수투자신탁)를 40% 미만으로 활용하여 투자 대상을 확장하고 분산투자를 추구합니다.

2. 위험관리

이 투자신탁은 시장 지표의 모니터링과 분석을 바탕으로 시장위험, 신용위험, 유동성 위험 등 위험을 사전인식하고 평가하는 과정을 통해 위험관리를 하고 있습니다.

3. 수익구조

이 투자신탁은 투자신탁재산의 90% 이상을 글로벌 주식에 주로 투자하는 모투자신탁에 투자하는 증권투자신탁(주식)으로서 투자한 모투자신탁의 가격변동에 따라 주된 이익 또는 손실이 결정됩니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드 수익률은 A 클래스 기준으로 4.65%의 수익률을 기록했습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

동 기간 글로벌 주식시장의 양상은 국가별로 일부 상이하였으나, 대체적으로 상승 후 일부 하락, 그리고 재차 상승하는 모습을 보였습니다. 1월 글로벌 주식시장은 인플레이션 피크아웃, 주택시장 회복 기대감으로 투자심리가 개선되며 큰 폭 상승 마감했습니다. 그간 낙폭이 심했던 고밸류 테크 기업들이 크게 반등하며 나스닥이 가장 아웃퍼폼하였고 유럽 증시 또한 경기침체와 긴축 우려를 일부 되돌리며 상승세를 이어갔습니다. 신흥국 증시도 중국의 위드코로나 전환과 함께 긍정적인 분위기를 이어갔으며 글로벌 테크기업들의 밸류체인이 많은 한국, 대만, 홍콩 중심으로 상승했습니다. 다만, 인도의 경우 아다니그룹의 추가조작 정황이 담긴 보고서에 의해 투자심리가 훼손되며 하락 마감했습니다. 2월 글로벌 주식시장은 각종 경제지표가 시장 예상을 크게 상회하자 인플레이션 압력이 확대될 수 있다는 우려가 재부각되면서 하락 마감했습니다. 국제금리가 재차 급등하면서 미국 증시는 전반적으로 하락하였고 고밸류 기업들이 주된 일본의 마더스 지수도 낙폭이 확대되었습니다. 반면, 유럽 증시는 1월 CPI가 시장 예상을 하회하며 인플레이션이 하락 추세에 진입하였고 2500억 유로 상당의 그린딜 산업계획과 핵심원자재법 (CRMA) 도입 발표로 투자 심리에 긍정적으로 작용했습니다. 신흥국 증시도 중국의 정찰풍선 이슈로 인해 미-중 갈등이 재조명되면서 투자 심리에 악영향을 미쳤고 이전 가장 선전하였던 홍콩 증시는 가장 큰 조정을 겪었습니다. 달러 인덱스 또한 재차 반등하면서 신흥국 증시 전반적으로 하락마감하였으나 AI 테마 수혜주가 상대적으로 많은 코스닥은 상승 마감하였습니다. 3월 글로벌 증시는 SVB 사태를 시작으로 은행주 중심으로 월초 증시 변동성이 확대되는 모습을 보였으나 금융당국과 주요 대형은행들의 빠른 대처로 인해 사태에 대한 우려는 점진적으로 완화되어 상승하는 추세입니다. 시장의 통화긴축 조기 종료 기대감이 계속됨에 따라 미국 증시는 오히려 성장주 중심으로 상승하고, 일본 증시 또한 BOJ의 완화 기조가 확인되면서 상승하고 있으나 유럽증시는 SVB 사태 이후에도 CS 및 도이체뱅크의 불안 확산이 이어져 하락하는 양상을 보이고 있습니다. 신흥국 증시 또한 서구권 금융불안으로 인해 대체로 하락 추세이며, 중국은 시장의 기대와 달리 부동산 부양정책이 언급되지 않아 소폭 하락 중입니다. 다만, 비교적 테크 성장주 비중이 많은 국내, 대만, 홍콩 증시는 상승 추세이며, 코스닥 같은 경우 IRA 발표를 앞두고 2차전자 업종이 급등하고 있습니다. 메타버스 테마는 연초부터 강한 랠리를 이어갔지만 현재 변화를 주도하는 CHATGPT가 이전에는 보여주지 못했던 1) 접근성 향상, 2) 정보력 향상, 3) 기술 확장을 가능케 하고 있어 다양한 산업에서 발빠른 변화를 일으킬 것으로 예상합니다. 이러한 변화의 수혜는 1차적으로 가치 사슬 기반 (인프라/반도체/보안 등) 을 제공하는 기업들이 가장 크게 받을 것으로 예상되지만, 검색시장에 시작으로 궁극적으로 데이터혁신을 통해 각종 센서/로봇/자율주행/우주산업 등 산업 전반에 적용될 것으로 전망합니다. 클린어스 테마에서는 당분간 미국의 IRA, 유럽의 CRMA 정책발표 이후 수혜가 예상되는 기업을 주목합니다. 이와 함께 최근 배터리 가격 하락이 가져올 전기차 및 ESS 시장의 변화에도 주목하고 있습니다. 한편, 미-중 갈등은 특히 첨단 기술산업과 관련해서 리스크로 작용하고 있으며, 최근 확산의 조짐이 있어 관련 종목들은 경계의 시각으로 접근하고 있습니다. 당분간 한쪽으로 치우친 포트폴리오보다 균형잡힌 배분이 유리하다고 보고 있으며, 하반기에는 보다 안정적인 매크로 환경과 함께 투자 매력도가 높아진 테마의 확산이 나타날 것으로 예상되어 동 펀드의 강점이 더 발휘될 것으로 보고 있습니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
클린에타버스자(H)(운용)	5.07	-2.07	-8.74	-25.30
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
클린에타버스자(H)A (비교지수 대비 성과)	4.65 -	-2.87 -	-9.89 -	-26.58 -
클린에타버스자(H)Ae (비교지수 대비 성과)	4.75 -	-2.68 -	-9.61 -	-26.27 -
클린에타버스자(H)C (비교지수 대비 성과)	4.59 -	-2.99 -	-10.05 -	-26.76 -
클린에타버스자(H)C-P1 (비교지수 대비 성과)	4.61 -	-2.94 -	-9.99 -	-26.69 -
클린에타버스자(H)C-P2 (비교지수 대비 성과)	4.64 -	-2.90 -	-9.93 -	-26.62 -
클린에타버스자(H)C-Pe1 (비교지수 대비 성과)	4.73 -	-2.73 -	-9.68 -	-26.35 -
클린에타버스자(H)C-Pe2 (비교지수 대비 성과)	4.74 -	-2.70 -	-9.64 -	-26.31 -
클린에타버스자(H)Ce (비교지수 대비 성과)	4.71 -	-2.75 -	-9.71 -	-26.38 -
클린에타버스자(H)Cs (비교지수 대비 성과)	4.82 -	-2.54 -	-9.41 -	-26.05 -
클린에타버스자(H)S (비교지수 대비 성과)	4.76 -	-2.65 -	-9.58 -	-26.23 -
클린에타버스자(H)S-P (비교지수 대비 성과)	4.78 -	-2.62 -	-9.53 -	-26.18 -
클린에타버스자(H)S-R (비교지수 대비 성과)	4.78 -	-2.62 -	-9.51 -	-26.16 -
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률 (비교지수 대비 성과)	4.82 -	-2.55 -	-9.42 -	-26.06 -
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
클린에타버스자(H)(운용)	-25.30	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	-	-	-	-
종류(Class)별 현황				
클린에타버스자(H)A (비교지수 대비 성과)	-26.58 -	- -	- -	- -
클린에타버스자(H)Ae (비교지수 대비 성과)	-26.27 -	- -	- -	- -
클린에타버스자(H)C (비교지수 대비 성과)	-26.76 -	- -	- -	- -
클린에타버스자(H)C-P1 (비교지수 대비 성과)	-26.69 -	- -	- -	- -
클린에타버스자(H)C-P2 (비교지수 대비 성과)	-26.62 -	- -	- -	- -
클린에타버스자(H)C-Pe1 (비교지수 대비 성과)	-26.35 -	- -	- -	- -
클린에타버스자(H)C-Pe2 (비교지수 대비 성과)	-26.31 -	- -	- -	- -
클린에타버스자(H)Ce (비교지수 대비 성과)	-26.38 -	- -	- -	- -
클린에타버스자(H)Cs (비교지수 대비 성과)	-26.05 -	- -	- -	- -

클린에타버스자(H)S (비교지수 대비 성과)	-26.23	-	-	-
클린에타버스자(H)S-P (비교지수 대비 성과)	-26.18	-	-	-
클린에타버스자(H)S-R (비교지수 대비 성과)	-26.16	-	-	-
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률 (비교지수 대비 성과)	-26.06	-	-	-
비교지수(벤치마크)	-	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : BM없음

※ 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 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	-357.46	0.00	0.00	12.74	0.00	257.88	0.00	0.00	0.00	-2.29	-124.27	-213.40
당 기	306.41	0.00	0.00	0.95	0.00	-37.70	0.00	0.00	0.00	3.85	-127.59	145.92

3. 자산현황

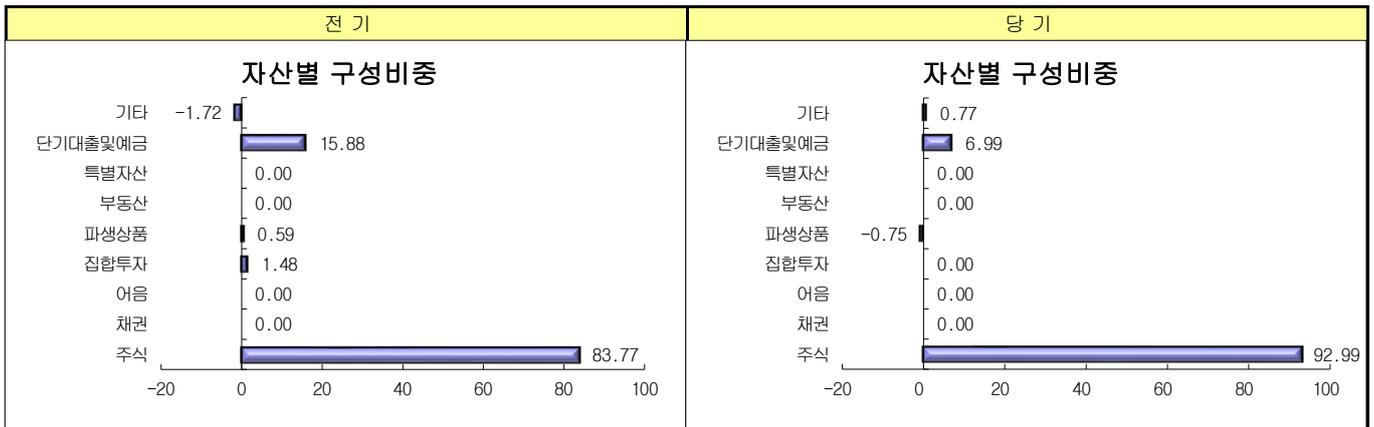
▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
CNH (188.99)	29 (0.94)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2 (0.06)	0 (0.00)	31 (1.01)
HKD (164.89)	110 (3.62)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	110 (3.62)
JPY (9.93)	77 (2.51)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	77 (2.51)
USD (1294.30)	2,567 (84.22)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	-23 (-0.75)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	20 (0.66)	0 (0.00)	2,564 (84.13)
KRW (1.00)	51 (1.69)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	191 (6.27)	23 (0.77)	266 (8.73)
합 계	2,834	0	0	0	0	-23	0	0	0	213	23	3,047

* () : 구성 비중

주) 위 자산구성현황의 자산총액에는 채권담보 및 미수입금 평가액을 포함하지 않습니다



▶ 주식업종별 투자비중

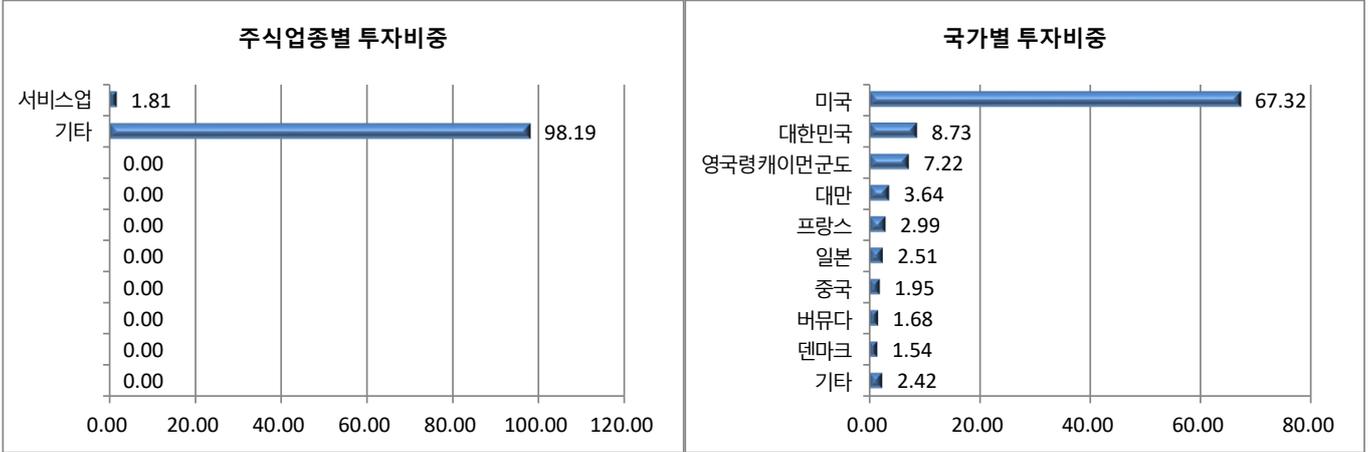
(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	서비스업	1.81	6		
2	기타	98.19	7		
3			8		
4			9		
5			10		

▶ 국가별 투자비중

(단위 : %)

순위	국가명	비중	순위	국가명	비중
1	미국	67.32	6	일본	2.51
2	대한민국	8.73	7	중국	1.95
3	영국령 케이먼 군도	7.22	8	버뮤다	1.68
4	대만	3.64	9	덴마크	1.54
5	프랑스	2.99	10	기타	2.42



주) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지란?	환헤지란 선물환계약, 한국거래소 통화선물 등 통화관련 파생상품 등을 이용하여 환율변동으로부터자산의 가치를 보호하는 것을 의미합니다. 따라서 환율이 하락(외화대비 원화가치 상승)할 경우, 환헤지 전략을 실행하면 환차익(환율 변동에 따른 손실)을 방지할 수 있습니다. 그러나 반대로 환율이 상승(원화대비 외화가치 상승)하는 경우에는 환차익을 얻을 수 있으나 환헤지 전략을 실행하면 추가이익의 기회가 상실될 수 있습니다. 또한 환헤지 전략을 실행할 경우 거래 수수료 등 추가 비용이 발생할 수 있습니다.
펀드수익률에 미치는 효과	이 투자신탁은 환헤지 전략을 통해 환율 변동이 펀드수익률에 미치는 영향을 감소시킬 수 있습니다. 환율이 하락(외화대비 원화가치 상승)할 경우 외화자산 가치의 하락으로 인한 손실이 발생하지만, 동시에 환헤지 계약에서 환차익이 발생하여 손익이 상쇄됩니다. 반면, 환율이 상승(원화대비 해당외화가치 상승)하는 경우 외화자산의 가치 상승으로 이익이 발생하지만, 동시에 환헤지 계약에서 환손실이 발생하여 손익이 상쇄됩니다. 하지만, 자산가치의 변동, 환헤지 시행 시기의 시차, 헤지비용등의이유로 환율 변동으로 인한 각각의 환차손과 환차이익이 완벽하게 상쇄되기는 불가능합니다.따라서집합투자업자가 환헤지를 수행한다고 하여 이 투자신탁의 수익률이 반a드시 긍정적인 효과를 나타내는 것도 아닙니다. 또한 환헤지를 실시할 경우 거래수수료 등의 추가적인 비용이 소요되어 펀드 수익률에 부정적인 영향을 줄 수도 있습니다.

(단위: %, 백만원)

투자설명서 상의 목표 환헤지 비율	환헤지 비율 (2023.03.26)	환헤지 비용 (2023.03.26)	환헤지로 인한 손익 (2023.03.26)
70% 이상	78.53	0	-38

주) 환헤지 비용은 통화선물거래에 따른 수수료이며, 선도환거래의 경우 수수료가 계약 환율에 반영되어 있어 별도의 산출은 불가능 합니다.

▼ 환헤지를 위한 파생상품의 보유현황

▶ 선도환

(단위: 계약, 백만원)

종류	거래상대방	기초자산	매수/매도	만기일	계약금액	취득가격	평가금액	비 고
FWD KRW/USD 230328	하나은행	USD	매도	2023-03-28	2,203	2,203	-23	

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	해외주식	NVIDIA CORP	6.84	6	해외주식	APPLE INC	3.88
2	해외주식	MICROSOFT CORP	6.32	7	해외주식	FIRST SOLAR INC	3.68
3	단기상품	은대	6.27	8	해외주식	TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	3.64
4	해외주식	ADVANCED MICRO DEVICES	5.17	9	해외주식	ROBLOX CORP -CLASS A	3.33
5	해외주식	Meta Platforms Inc	4.17	10	해외주식	IMPINJ INC	3.21

※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

▶ 주식

(단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
NVIDIA CORP	592	209	6.84	미국	USD	Semiconductors	
MICROSOFT CORP	536	193	6.32	미국	USD	Software	
ADVANCED MICRO DEVICES	1,213	157	5.17	미국	USD	Semiconductors	
Meta Platforms Inc	480	127	4.17	미국	USD	Software	
APPLE INC	574	118	3.88	미국	USD	Hardware	
FIRST SOLAR INC	412	112	3.68	미국	USD	Capital Goods	
TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR	905	111	3.64	대만	USD	Semiconductors	
ROBLOX CORP -CLASS A	1,862	101	3.33	미국	USD	기타	
IMPINJ INC	563	98	3.21	미국	USD	Semiconductors	

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	하나은행	2021-09-27	191	2.99		대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
유주형	차장	38	13	1,894	1	557	2115000822
오남훈	본부장	46	14	3,351	20	24,033	2109001266
김형중	사원	31	10	1,844	-	-	2120001043

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 운용전문인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. (인터넷 주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기간	운용전문인력
2021.09.27 ~ 현재	유주형
2021.09.27 ~ 현재	오남훈
2022.04.26 ~ 현재	김형중

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
클린메타버스자(H)(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**	1	0.05	3	0.09	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	1	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	2	0.05	3	0.08
		합계	2	0.06	3	0.10
	증권거래세	1	0.02	1	0.02	
클린메타버스자(H)A	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.17	0	0.17	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.41	0	0.40	
	기타비용**	0	0.05	0	0.10	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)Ae	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.07	0	0.07	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
	보수합계	1	0.31	1	0.31	
	기타비용**	0	0.05	0	0.09	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)C	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.24	0	0.23	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.47	0	0.46	
	기타비용**	0	0.05	0	0.10	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.06	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	

클린메타버스자(H)C-P1	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.21	0	0.21	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.45	0	0.44	
	기타비용**	0	0.05	0	0.09	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)C-P2	자산운용사	1	0.21	1	0.21	
	판매회사	1	0.19	1	0.18	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
	보수합계	1	0.42	1	0.42	
	기타비용**	0	0.05	0	0.10	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)C-Pe1	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.10	0	0.10	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
	보수합계	0	0.33	0	0.33	
	기타비용**	0	0.05	0	0.10	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)C-Pe2	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.09	0	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.32	0	0.32	
	기타비용**	0	0.05	0	0.09	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)Ce	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.11	0	0.11	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.35	0	0.34	
	기타비용**	0	0.05	0	0.09	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	

클린메타버스자(H)Cs	자산운용사	5	0.21	5	0.21	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
	보수합계	5	0.24	5	0.23	
	기타비용**	1	0.05	2	0.10	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	1	0.05	2	0.08
		합계	1	0.06	2	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)S	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.06	0	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.30	0	0.29	
	기타비용**	0	0.05	0	0.09	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)S-P	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.05	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.28	0	0.28	
	기타비용**	0	0.05	0	0.09	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.06	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	
클린메타버스자(H)S-R	자산운용사	0	0.21	0	0.21	
	판매회사	0	0.05	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.02	0	0.02	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.28	0	0.28	
	기타비용**	0	0.05	0	0.09	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.00	0	0.02
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.05	0	0.08
		합계	0	0.06	0	0.10
	증권거래세	0	0.02	0	0.02	

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
클린메타버스자(H)(운용)	전기	0.185	0.2341	0.4191
	당기	0.3838	0.4087	0.7925
종류(Class)별 현황				
클린메타버스자(H)A	전기	1.8254	0.233	2.0584
	당기	2.024	0.4077	2.4317
클린메타버스자(H)Ae	전기	1.4278	0.2353	1.6631
	당기	1.6221	0.4115	2.0336
클린메타버스자(H)C	전기	2.0854	0.2479	2.3333
	당기	2.2702	0.4065	2.6767

클린메타버스자(H)C-P1	전기	1.9751	0.2361	2.2112
	당기	2.173	0.4093	2.5823
클린메타버스자(H)C-P2	전기	1.8775	0.2345	2.112
	당기	2.0772	0.4096	2.4868
클린메타버스자(H)C-Pe1	전기	1.5284	0.2354	1.7638
	당기	1.7279	0.4067	2.1346
클린메타버스자(H)C-Pe2	전기	1.4741	0.2347	1.7088
	당기	1.673	0.4092	2.0822
클린메타버스자(H)Ce	전기	1.5738	0.2348	1.8086
	당기	1.7729	0.4095	2.1824
클린메타버스자(H)Cs	전기	1.1385	0.2342	1.3727
	당기	1.3379	0.4092	1.7471
클린메타버스자(H)S	전기	1.3733	0.2345	1.6078
	당기	1.5728	0.4093	1.9821
클린메타버스자(H)S-P	전기	1.3163	0.2404	1.5567
	당기	1.5086	0.4075	1.9161
클린메타버스자(H)S-R	전기	1.3043	0.2343	1.5386
	당기	1.5037	0.4072	1.9109

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
74,747	4,545	71,288	4,165	87.79	356.02

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

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

클린메타버스(주식)(모펀드)

2022년06월27일 ~ 2022년09월26일	2022년09월27일 ~ 2022년12월26일	2022년12월27일 ~ 2023년03월26일
99.51	54.70	87.79

7. 동일한[해당] 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

▶ 투자현황

(단위 : 주, %)

투자대상 집합투자기구 현황		투자대상 집합투자증권 보유수(B)	보유비중 (=B/A*100(%))
집합투자기구명	발행총수(A)		
-	-	-	-

8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 가. 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

1. 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등	
유동성 위험	증권시장규모 등을 감안할 때 거래량이 풍부하지 못한 종목에 투자할 경우 투자대상종목의 유동성 부족에 따른 환금성의 결여가 투자신탁재산 가치의 하락을 초래할 위험이 발생할 수 있습니다.
오퍼레이션 위험	해외투자의 경우 국내투자자와 달리 시차에 의한 시장폐장 및 개장시가의 차이로 신탁재산의 평가에 있어 시차가 발생할 수도 있습니다. 또한 복잡한 결제과정 및 현금 운용과정에서 운용적인 위험이 국내투자자보다 더 높습니다.

국가위험	이 투자신탁은 해외 주식 등에 투자하기 때문에 투자 대상 국가의 시장, 정치 및 경제상황 등에 따른 위험에 노출되어 있습니다. 또한 정부정책 및 제도의 변화로 인해 자산가치의 손실이 발생할 수 있으며, 외국인에 대한 투자제한, 조세제도 변화 등의 정책적 변화 및 사회전반적인 투명성 부족으로 인한 공시자료의 신뢰성 등의 위험도 있습니다. 특히 일부 신흥시장에 투자하는 경우 외국인의 투자한도, 넓은 매매호가 차이, 거래소의 제한된 개장시간과 거래량 부족 등으로 인하여 유동성에 제약이 발생할 수도 있습니다. 따라서 선진국가, 글로벌 시장에 투자하는 것에 비해 상대적으로 투자대상 국가의 위험에 크게 노출될 수 있습니다.
외국세법에 의한 과세에 따른 위험	이 투자신탁이 해외주식(주식예탁증권 포함) 및 해외채권에 투자할 수 있으며, 해외 유가증권에 투자할 경우 해당 유가증권이 거래되는 특정국가의 세법에 영향을 받습니다. 특정 외국의 세법에 의한 배당소득세, 양도소득세 등이 부과될 수 있고, 향후 특정 외국의 세법 변경으로 높은 세율이 적용될 경우 세후 배당소득, 세후 양도소득 등이 예상보다 감소하여 투자신탁 재산에 영향을 미칠 수 있습니다.
파생상품 관련 위험	파생상품에의 투자는 적은 증거금으로 거액의 결제가 가능한 지렛대 효과(레버리지 효과)로 인하여 기초자산에 직접 투자하는 경우에 비하여 높은 위험에 노출될 수 있습니다. 기초 자산의 가격변동성을 완화하기 위한 헤지전략과 자산배분전략을 구사함에도 불구하고, 파생상품은 시장 내의 수급과 시장 외부변수에 따라 기초자산의 움직임과 상이하게 움직일 경우 파생상품에 투자하는 투자자에게 예상하기 어려운 투자자산 가치의 변화를 초래할 수 있습니다. 장외파생상품으로 운용되는 경우 거래상대방 신용위험에 노출되며 급격한 시장 변동, 거래상대방의 신용 악화 및 기타 예측하지 못한 변수로 인해 장외파생상품 매매에 따른 거래상대방 신용위험이 발생할 가능성이 있습니다.

2. 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

동기간 환매중단, 상환연기, 부실자산 발생 관련 위험은 없었으며, 보고서 작성 시점에서 동 위험의 발생 가능성은 제한적입니다.

▶ 나. 주요 위험 관리 방안

1. 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등	
유동성위험	보유종목의 시장유동성 점검은 초저유동성 종목에 대하여 모니터링하고, 종목별 전량매도소요일, 중소형주 비중 점검 등을 통하여 관리하고 있으며, 위험발생이 예상되는 경우 즉시 위험관리위원회를 개최하여 대응방안을 마련하며, 펀드의 유동성관리는 펀드별 현금자산 및 유동성비중에 대하여 Daily 모니터링하고, 환매스케줄 및 자금관리에 만전을 기하고 있습니다.
신용위험	주식 및 채권의 경우 Buying List 종목에 한해 투자 가능하며, Buying List 선정시 종목의 신용위험에 대한 점검절차를 가지고 있으며, 신용등급의 변동에 대하여 데일리 모니터링하고, 신용등급이 규정에서 정한 등급 미만으로 하락시에는 위험관리위원회의 점검절차를 통하여 대응방안을 마련하여 대응합니다. AP거래의 경우 거래처 및 담보증권 점검을 통하여 신용위험을 관리하고 있습니다.
시장위험	주식편입비, 종목별 편입비 등의 한도를 규약에 정하고, 한도 내에서의 운용을 원칙으로 하고 있으며, 개별주식종목의 경우 Loss-cut 규정을 두고 있음. 또한 펀드별 TE, IR, MDD 등의 위험조정성과지표의 관리를 통하여 시장위험을 관리하고 있습니다.
파생상품 관련위험	파생상품의 편입 한도를 규약에 정하고, 한도 내에서의 운용을 원칙으로 하고 있으며, 파생상품거래에 따른 위험평가액을 매일 모니터링하고 점검합니다.
환위험	환헤지 전략을 사용하는 펀드에 한하여 선물환계약 등의 통화관련 파생상품에 투자하여 보유통화의 환율변동 위험을 줄일 수 있으며, 해당 파생상품에의 투자와 관련하여 헤지비용, 파생상품편입한도, 파생상품위험액 등의 한도관리를 통하여 관리하고 있습니다.
오퍼레이션 위험	해외투자의 경우 국가별 시차, 결제과정의 차이로 인하여 발생할 수 있는 오퍼레이션위험을 최소화 하기 위하여 사전적 절차확인 및 크로스체크 등의 과정을 두어 오퍼레이션 위험을 최소화 하고 있습니다.
통제방안	규약, 법규 및 내부 운용지침 등에서 요구하는 위험관리 항목과 일상적으로 발생할 수 있는 위험요소에 대하여 데일리 및 상시 모니터링하고 있으며, 주간 리스크관리리포트를 통한 점검, 월1회 정기 위험관리실무위원회 등의 점검절차를 가지고 있으며, 실제 위험요인 발생시 즉각적으로 위험관리위원회를 개최하여 위험요인 분석 및 그에 따른 해결 방안 강구하고 추가적인 위험 발생의 방지에 최선을 다합니다.

2. 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한 과 수단 등

해당사항 없음

3. 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등

해당사항 없음

▶ 다. 자전거래 현황

1. 자전거래규모

최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
0	0	0	0

2. 최근 1년간 자전거래 발생 시 자전거래 사유, 관련 펀드간 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차 등

해당사항 없음

▶ 라. 주요 비상대응계획

집합투자재산위험관리규정 제39조(집합투자재산 운용에 따른 비상계획의 수립 및 점검)에 의거하여 ‘운용관련 비상상황에 대한 단계별 가이드라인’을 제정하고 운영하고 있으며, 대규모환매청구, 보유자산의 중대한 손실, 보유자산의 부실화 등의 정량적인 사항은 시스템으로 구축하여 데일리 모니터링 및 단계별 점검사항 발생시 위험요소에 대하여 점검하고, 조속하게 대처하여 추가적인 위험상황으로의 확대를 방지하고, 재난.재해, 민원 및 소송, 금융사고 등의 발생에 대하여도 위기상황에 대하여 단계별로 정의하고 발생시 단계별 대응방안에 따르며, 재난.재해의 경우에는 발생 즉시 비상대책위원회를 소집하여 BCP점검 및 비상대응계획을 수립하여 시행하여 위험을 최소화 하도록 최선을 다합니다.

9. 자산운용사의 고유재산 투자 및 회수에 관한 사항

▶ 투자 및 회수 현황

(단위 : 백만원, %)

펀드명	분류	투자일	투자금	회수일	회수금	투자잔액	수익률
클린메타버스(H)Cs	의무투자	2021-09-27	200	-	-	200	-31.83%
클린메타버스(H)Cs	추가투자	2021-09-27	3,000	-	-	3,000	-31.83%

주1) 투자금액 및 수익률은 자산운용사의 운용전략에 따라 추가설정(환매)될 수 있으며, 이에 따라 투자금액 및 수익률이 변동될 수 있습니다.

주2) 투자금 및 회수금은 원본액 기준으로 작성하였습니다.

주3) 수익률은 작성일 기준 시점의 투자금액(잔액)에 대한 평가수익률로 산정하며 소수점 둘째자리까지 표시하였습니다.

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스글로벌클린메타버스성장주증권투자신탁(H)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 하나은행의 확인을 받아 판매회사인 KB증권, 교보증권, 대신증권, 키움증권, 하나증권, 한국포스증권, 현대차증권을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예탁된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예탁된 날 이후 기간에 한합니다.

※ 「자산운용사의 자기 공모펀드 투자 행정지도」에 의거하여, 당사 고유재산 의무 투자기간이 2024.09.27(투자일로부터 3년) 종료됨을 안내드립니다. 의무 투자기간의 종료는 자금의 회수를 의미하는 것은 아니며, 의무 투자기간 종료 이후 당사는 행정지도에서 정하는 방법에 따라 투자금을 회수할 수 있습니다.