

# 자산운용보고서

마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용)

(운용기간 : 2023년02월24일 ~ 2023년05월23일)

○ 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
  - ▶ 투자대상 상위 10종목
  - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
  - ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
- 5 비용현황
  - ▶ 업자별 보수 지급현황
  - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
  - ▶ 매매주식규모 및 회전을
  - ▶ 최근 3분기 매매회전을 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
마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용) 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)A 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)AG 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)Ae 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-P1 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-P2 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-Pe1 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)C-Pe2 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)CG 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)Ce		5등급	AX668 AX669 BP347 AX670 AX671 BU378 B8572 BU379 BU380 BP348 AX672	해당하지 않음
펀드의 종류	투자신탁, 증권펀드(혼합채권형), 개방형, 추가형, 종류형	최초설정일	2014.11.24	
운용기간	2023.02.24 ~ 2023.05.23	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 바랍니다.			
자산운용회사	마이다스에셋자산운용(주)	펀드재산보관회사	신한은행	
판매회사	IBK투자증권, 기업은행, 신한은행, 우리은행, 유안타증권, 키움증권, 하나은행, 한국투자증권	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, 블랙딜 등에도 선별적으로 투자할 수 있습니다.			

## ▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
단기국공채공모주1(채혼)(운용)	자산 총액 (A)	37,223	33,075	-11.14
	부채 총액 (B)	24	18	-22.49
	순자산총액 (C=A-B)	37,199	33,057	-11.14
	발행 수익증권 총 수 (D)	32,422	28,492	-12.12
	기준가격 <sup>주)</sup> (E=C/D×1000)	1,147.32	1,160.20	1.12
종류(Class)별 기준가격 현황				
단기국공채공모주1(채혼)A	기준가격	1,099.74	1,110.24	0.95
단기국공채공모주1(채혼)AG	기준가격	1,055.97	1,066.36	0.98
단기국공채공모주1(채혼)Ae	기준가격	1,104.28	1,115.30	1.00
단기국공채공모주1(채혼)C	기준가격	1,093.56	1,103.32	0.89
단기국공채공모주1(채혼)C-P1	기준가격	1,049.90	1,059.82	0.94
단기국공채공모주1(채혼)C-P2	기준가격	1,097.33	1,107.80	0.95
단기국공채공모주1(채혼)C-Pe1	기준가격	1,051.55	1,061.97	0.99
단기국공채공모주1(채혼)C-Pe2	기준가격	1,097.56	1,108.50	1.00
단기국공채공모주1(채혼)CG	기준가격	1,050.57	1,060.43	0.94
단기국공채공모주1(채혼)Ce	기준가격	1,100.95	1,111.59	0.97

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 90% 이하를 국채, 통화안정증권, 우량 회사채 등의 채권에 주로 투자합니다. 또한 투자신탁재산의 30% 이하의 범위에서 공모주 등 국내 주식에 투자하여 운용할 계획입니다. 각 부문의 운용 전략은 다음과 같습니다.

#### 채권 투자전략

- 이 투자신탁은 투자신탁재산의 대부분을 국채, 통안채, 공사채, 지방채 등의 국공채에 투자하며 우량 회사채에도 선별적으로 투자할 계획입니다.
- 듀레이션을 1년 내외 수준으로 하여 금리 상승시 자본손실 최소화를 추구합니다.

#### 주식 투자전략

- 투자신탁재산의 30% 이하에서 공모주에 주로 투자하며, 실권주, 불특정 등에도 선별적으로 투자할 수 있습니다.
- 철저한 가치평가 중심의 공모주 투자로 투자대상 종목을 선정하며, 펀드매니저의 기업탐방 및 대내외 리서치 기관을 활용한 철저한 기업분석에 따른 가치평가를 통해 투자수익을 추구합니다.

### 2. 위험관리

이 투자신탁은 주식 및 채권에 투자하는 혼합채권 형 투자신탁으로 주식 및 채권 관련 파생상품의 가격변동에 의한 손실 위험에 노출됩니다. 개별 주식 및 채권, 파생상품의 가격 변동으로 인한 위험을 제한하기 위하여 동일 종목 투자한도 및 파생상품에 대한 투자한도를 두고 있습니다.

### 3. 수익구조

이 투자신탁은 투자신탁재산의 대부분을 채권 및 주식에 투자하는 증권투자신탁으로서 주된 투자대상인 채권의 이자수익 및 가격 변동으로 인한 자본손익과 국내 주식의 가격변동에 따라 투자자의 이익 또는 손실이 결정됩니다.

## 2. 운용경과 및 수익률현황

### ▶ 운용경과

펀드 수익률은 A클래스 기준 -0.95%로 비교지수 대비 0.40%p 낮은 수준을 기록하였습니다.

2월 펀드는 공모주 공모주 3건을 상장일 매도 완료하였으며(스튜디오미르, 샌즈랩, 제이오), 세 종목 모두 상장 직후 우수한 수익률을 기록하여 펀드 성과에 긍정적으로 기여하였습니다(스튜디오미르 +160.00%, 샌즈랩 +160.00%, 제이오 +57.78%).

3월 펀드는 공모주 3건을 상장일 매도 완료하였으며(바이오인프라, 나노팀, LB인베스트먼트), 세 종목 모두 상장 직후 우수한 수익률을 기록하여 펀드 성과에 긍정적으로 기여하였습니다(바이오인프라 +61.50%, 나노팀 +142.65%, LB인베스트먼트 +35.78%).

4월 펀드는 물량을 배정받은 '마이크로투나노'를 상장일 당일(4/26) 매도 완료하였으며 매도가가 공모가의 74.15%를 상회하며 펀드 성과에 긍정적으로 기여하였습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용 계획

#### [주식]

동 기간 KOSPI는 5.27% 상승하였습니다.

3월까지도 IPO 시장은 중소형주가 강세를 보이며 흥행 사례가 다수 있었지만, 1분기 IPO '대어'로 기대를 모았던 종목이 상장을 철회하면서 대형사 상장이 부재했으며, 3월 중 상장 예정이었던 유망 종목 또한 증권 신고서 정정 요청으로 상장 철회 혹은 연기되어 다시 소강상태로 접어들었습니다.

4월에는 스펙이 잇따라 상장을 철회하고 증권 신고서 정정에 따른 일부 종목들의 IPO 일정이 연기되며, IPO 공모액 규모가 전월 대비 40% 수준으로 급감했습니다. 동월 IPO를 진행하는 기업들의 주요 일정은 대부분 비슷한 시기에 집중되어 있어 예상보다 자금 모집이 저조한 기업은 상장 철회 우려도 있지만, 5월의 공모액 규모는 반등할 것으로 전망했습니다.

5월 IPO 시장은 중소형주 위주로 훈풍이 부는 모습입니다. 6월부터는 신규 상장되는 기업의 첫날 가격제한폭이 공모가의 60~400%로 공모주의 업사이드(상승 여력)가 확대되면서 청약에 대한 투자자들의 관심도 커질 것으로 기대됩니다. 상반기는 중소형 공모주 다수가 흥행에 성공한 반면 쉐리, 케이뱅크, 오아시스 등 대형주는 상장 일정을 연기하거나 철회했지만, 하반기에는 기업가치가 조 단위로 추산되는 '대어'들이 IPO 시장에 나올 것으로 예상됩니다. 펀드는 높은 경쟁률이 예상되거나 향후 장기적으로 이익 가시성이 예상되는 기업에 대해서는 의무 보유 확약을 걸어 적극적으로 참여할 예정입니다.

#### [채권]

동 기간 채권금리는 하락하는 모습을 보이다가 상승하고 있습니다.

3월 국고 금리는 하락하였습니다(국고 3년 3.290%, -0.52%p/국고10년 3.360%, -0.40%p). 국내 2월 소비자물가가 전년 대비 4.8%를 기록하며 물가 상승폭이 둔화된 것과 더불어, 미국 실리콘밸리 은행 파산, 유럽 크레딧스위스 신중자본증권(AT1)의 전망 상각 등에서 파생된 은행권 시스템 리스크에 대한 우려가 금리 하락 요인으로 작용하였습니다. 여기에 연준의 통화정책 전환이 이루어질 것이라는 기대감이 추가적으로 국내외 금리 하락에 영향을 미쳤습니다.

4월에는 미국 등의 금융안정성 우려에도 고물가 흐름이 지속되며 국고 금리는 소폭 상승 하였습니다(국고 3년 3.300%, +0.01%p / 국고10년 3.367%, +0.007%p). 미국 ISM제조업이 50을 하회하는 등 국내외 경기 하방 압력이 지속되는 가운데, 미국의 중소은행들에 대한 건전성 우려가 확대되었습니다. 그러나 문제 은행들이 연방예금보험공사의 관리 하에 매각되며, 시스템 리스크로의 확산 가능성은 제한되었습니다. 여기에 미국 근원물가가 5% 중반대의 오름세를 유지함에 따라, 연준 금리 추가 인상 가능성이 확대되며 국고 금리는 소폭 상승하였습니다.

5월 국고 금리는 상승하는 모습을 보이고 있습니다. 긴축 우려 및 추경 가능성 등이 금리 상승 요인으로 작용하였습니다. 미국 FOMC는 기준금리를 5.0~5.25%로 25bp 인상하며, 추가 금리 인상 종료 가능성이 제기되었습니다. 그러나 높은 기대 인플레이션으로 일부 연준 위원들은 추가 인상 가

능성을 시사하였습니다. 여기에 금통위는 기준금리를 3.5%로 만장일치 동결하였으나, 금통위원 전원이 최종 금리 수준을 3.75%까지 고려하고 있다고 밝혔습니다. 그리고 세수 부족으로 인한 추경 가능성 역시 금리 상승 요인으로 작용하였습니다. 6월 금리는 박스권 등락을 전망합니다. 통계청 4월 경기선행지수 순환변동치가 6개월 연속 하락하는 가운데, 5월 수출은 전년 비 -15.2%로 부진하며 14개월 연속 무역수지 적자를 보이고 있습니다. 여기에 5월 소비자물가 전년 비가 3.3%로 오름세가 둔화되고 있는 점 역시 채권 시장에는 긍정적인 요인입니다. 반면 국고 금리는 기준금리 인하를 선반영하고 있음에도, 주요국 중앙은행들이 통화 긴축 기조 유지를 재확인하는 점 등은 가격 부담 요인입니다. 따라서 금리 상, 하단이 제한된 박스권 등락을 전망합니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %, %p)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	1.12	3.43	2.61	2.45
(비교지수 대비 성과)	(-0.23)	(0.43)	(-0.31)	(-0.06)
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A (비교지수 대비 성과)	0.95 (-0.40)	3.08 (0.08)	2.08 (-0.84)	1.75 (-0.76)
단기국공채공모주1(채훈)AG (비교지수 대비 성과)	0.98 (-0.37)	3.14 (0.14)	2.18 (-0.74)	1.89 (-0.62)
단기국공채공모주1(채훈)Ae (비교지수 대비 성과)	1.00 (-0.35)	3.17 (0.17)	2.22 (-0.70)	1.93 (-0.58)
단기국공채공모주1(채훈)C (비교지수 대비 성과)	0.89 (-0.46)	2.95 (-0.05)	1.89 (-1.03)	1.50 (-1.01)
단기국공채공모주1(채훈)C-P1 (비교지수 대비 성과)	0.94 (-0.41)	3.06 (0.06)	2.05 (-0.87)	1.71 (-0.80)
단기국공채공모주1(채훈)C-P2 (비교지수 대비 성과)	0.95 (-0.40)	3.08 (0.08)	2.08 (-0.84)	1.75 (-0.76)
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe1 (비교지수 대비 성과)	0.99 (-0.36)	3.15 (0.15)	2.20 (-0.72)	1.90 (-0.61)
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2 (비교지수 대비 성과)	1.00 (-0.35)	3.17 (0.17)	2.21 (-0.71)	1.93 (-0.58)
단기국공채공모주1(채훈)CG (비교지수 대비 성과)	0.94 (-0.41)	3.05 (0.05)	2.03 (-0.89)	1.68 (-0.83)
단기국공채공모주1(채훈)Ce (비교지수 대비 성과)	0.97 (-0.38)	3.10 (0.10)	2.12 (-0.80)	1.80 (-0.71)
비교지수(벤치마크)	1.35	3.00	2.92	2.51

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

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	2.45	5.63	10.40	17.73
(비교지수 대비 성과)	(-0.06)	(3.92)	(5.14)	(8.87)
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A (비교지수 대비 성과)	1.75 (-0.76)	4.20 (2.49)	8.16 (2.90)	13.77 (4.91)
단기국공채공모주1(채훈)AG (비교지수 대비 성과)	1.89 (-0.62)	4.51 (2.80)	8.41 (3.15)	9.19 (0.33)
단기국공채공모주1(채훈)Ae (비교지수 대비 성과)	1.93 (-0.58)	4.57 (2.86)	8.75 (3.49)	14.81 (5.95)
단기국공채공모주1(채훈)C (비교지수 대비 성과)	1.50 (-1.01)	3.68 (1.97)	7.35 (2.09)	12.37 (3.51)
단기국공채공모주1(채훈)C-P1 (비교지수 대비 성과)	1.71 (-0.80)	4.12 (2.41)	- -	- -
단기국공채공모주1(채훈)C-P2 (비교지수 대비 성과)	1.75 (-0.76)	4.20 (2.49)	8.16 (2.90)	13.78 (4.92)

단기국공채공모주1(채훈)C-Pe1 (비교지수 대비 성과)	1.90 (-0.61)	4.51 (2.80)	- -	- -
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2 (비교지수 대비 성과)	1.93 (-0.58)	4.56 (2.85)	8.72 (3.46)	- -
단기국공채공모주1(채훈)CG (비교지수 대비 성과)	1.68 (-0.83)	4.06 (2.35)	- -	- -
단기국공채공모주1(채훈)Ce (비교지수 대비 성과)	1.80 (-0.71)	4.30 (2.59)	8.32 (3.06)	14.06 (5.20)
비교지수(벤치마크)	2.51	1.71	5.26	8.86

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		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	21.39	810.53	0.00	29.55	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	46.47	-2.10	905.84
당기	35.71	283.13	0.00	27.90	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	44.47	-1.15	390.07

**3. 자산현황**

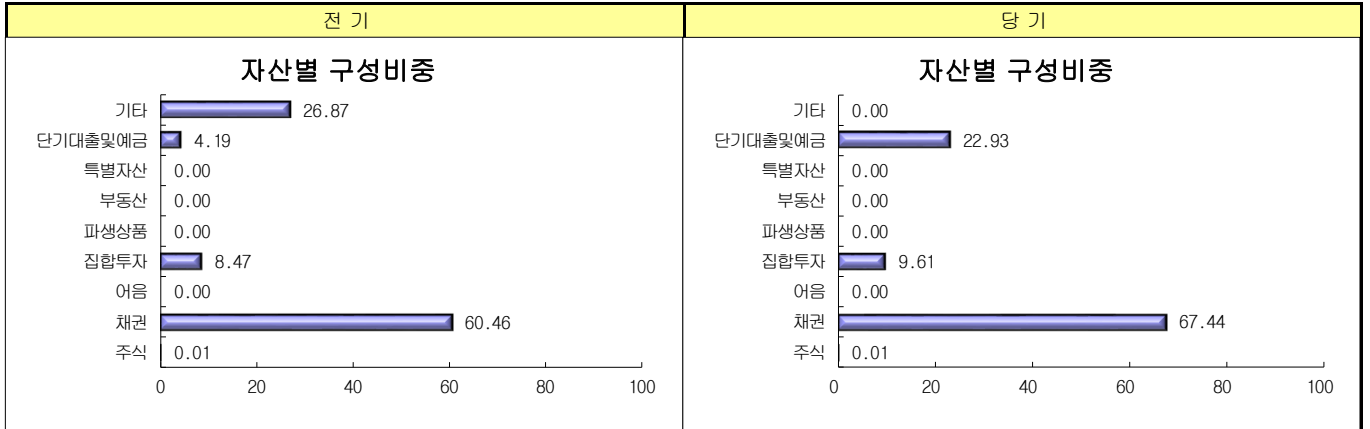
▶ **자산구성현황**

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW (1.00)	3 (0.01)	22,307 (67.44)	0 (0.00)	3,180 (9.61)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	7,586 (22.93)	0 (0.00)	33,075 (100.00)
합계	3	22,307	0	3,180	0	0	0	0	0	7,586	0	33,075

\* ( ) : 구성 비중

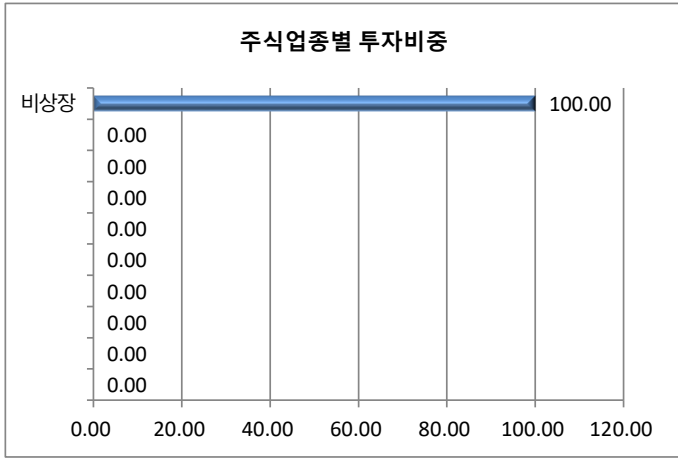
주) 위 자산구성현황의 자산총액에는 채권담보 및 미수입금 평가액을 포함하지 않습니다



▶ **주식업종별 투자비중**

(단위 : %)

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



주) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

#### ▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	채권	통안03680-2501-02	6	채권	국고01000-2306(20-3)
2	채권	한국전력1098	7	주식	기가비스공모(보)
3	단기상품	은대	8		
4	집합투자증권	KODEX 단기채권	9		
5	채권	국고04250-2512(22-13)	10		

※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
기가비스공모(보)	68	3	0.01	대한민국	KRW	기타	

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

##### ▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안03680-2501-02	10,000	10,082	대한민국	KRW	2023-01-02	2025-01-02		RF	30.48
한국전력1098	10,000	9,843	대한민국	KRW	2021-12-02	2024-12-02		AAA	29.76
국고04250-2512(22-13)	2,000	2,081	대한민국	KRW	2022-12-10	2025-12-10		RF	6.29
국고01000-2306(20-3)	300	301	대한민국	KRW	2020-06-10	2023-06-10		RF	0.91

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

##### ▶ 집합투자증권

(단위: 백만원, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
KODEX 단기채권	수익증권	삼성자산운용(ETF)	3,122	3,180	대한민국	KRW	9.61

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

##### ▶ 단기대출 및 예금

(단위: 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	신한은행	2014-11-24	7,583	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	
김예리	부장	42	15	5,573	16	3,220	2109001471
김민수	부장	42	9	12,888	2	2,214	2111000836
박미나	차장	36	3	681	-	-	2119001058

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 수사공시 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
2018.03.16 ~ 현재	김민수 김예리 박미나 김기태 김연우 기민수 송형섭
2021.07.16 ~ 현재	
2021.07.16 ~ 현재	
2022.10.14 ~ 2022.11.28	
2022.05.06 ~ 2022.05.06	
2020.07.13 ~ 2020.12.15	
2019.06.14 ~ 2021.07.15	

## 5. 비용 현황

### ▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

	구분	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**	1	0.00	1	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.00	1	0.00
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.00	1	0.00
		증권거래세	0	0.00	0	0.00
단기국공채공모주1(채훈)A	자산운용사	6	0.08	4	0.07	
	판매회사	7	0.09	5	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	15	0.17	10	0.17	
	기타비용**	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



단기국공채공모주1(채훈)AG	자산운용사	0	0.07	0	0.07	
	판매회사	0	0.06	0	0.06	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.14	0	0.14	
	기타비용**	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	
단기국공채공모주1(채훈)Ae	자산운용사	1	0.08	1	0.07	
	판매회사	1	0.04	1	0.04	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	2	0.13	2	0.12	
	기타비용**	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	
단기국공채공모주1(채훈)C	자산운용사	7	0.08	6	0.07	
	판매회사	14	0.15	13	0.15	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	23	0.24	20	0.23	
	기타비용**	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	
단기국공채공모주1(채훈)C-P1	자산운용사	0	0.07	0	0.07	
	판매회사	0	0.10	0	0.10	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.18	0	0.18	
	기타비용**	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	
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	자산운용사	3	0.08	3	0.07	
	판매회사	4	0.09	4	0.09	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	8	0.17	8	0.17	
	기타비용**	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	
	자산운용사	0	0.08	0	0.07	
	판매회사	0	0.05	0	0.05	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	1	0.13	1	0.13	

단기국공채공모주1(채훈)C-Pe1	기타비용**		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
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	자산운용사		9	0.08	8	0.07
	판매회사		5	0.04	5	0.04
	펀드재산보관회사(신탁업자)		1	0.01	1	0.00
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		15	0.13	14	0.12
	기타비용**		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
	단기국공채공모주1(채훈)CG	자산운용사		0	0.08	0
판매회사		0	0.11	0	0.10	
펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00	
보수합계		0	0.19	0	0.18	
기타비용**		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	
단기국공채공모주1(채훈)Ce		자산운용사		2	0.08	2
	판매회사		2	0.08	2	0.07
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.00
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		5	0.16	4	0.15
	기타비용**		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 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)
단기국공채공모주1(채훈)(운용)	전기	0.0091	0.0145	0.0236
	당기	0.0096	0.0143	0.0239
종류(Class)별 현황				
단기국공채공모주1(채훈)A	전기	0.6964	0.0145	0.7109
	당기	0.6968	0.014	0.7108
단기국공채공모주1(채훈)AG	전기	0.5662	0.014	0.5802
	당기	0.5754	0.0143	0.5897
단기국공채공모주1(채훈)Ae	전기	0.5163	0.0143	0.5306
	당기	0.5166	0.014	0.5306
단기국공채공모주1(채훈)C	전기	0.9464	0.0145	0.9609
	당기	0.9469	0.0144	0.9613
단기국공채공모주1(채훈)C-P1	전기	0.7343	0.0138	0.7481
	당기	0.7329	0.0143	0.7472
단기국공채공모주1(채훈)C-P2	전기	0.6964	0.0142	0.7106
	당기	0.6968	0.0144	0.7112

단기국공채공모주1(채훈)C-Pe1	전기	0.5459	0.0144	0.5603
	당기	0.5463	0.0142	0.5605
단기국공채공모주1(채훈)C-Pe2	전기	0.5214	0.0146	0.536
	당기	0.5219	0.0144	0.5363
단기국공채공모주1(채훈)CG	전기	0.762	0.0143	0.7763
	당기	0.7627	0.0143	0.777
단기국공채공모주1(채훈)Ce	전기	0.6463	0.0145	0.6608
	당기	0.6468	0.0143	0.6611

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*	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
0	0	11,735	112	1240.98	5089.40

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율

### ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

2022년08월24일 ~ 2022년11월23일	2022년11월24일 ~ 2023년02월23일	2023년02월24일 ~ 2023년05월23일
832.31	1,668.91	1,240.98

## 7. 동일한[해당] 집합투자업자가 운영하는 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.
신용위험	채무불이행 위험은 채권의 발행주체가 현금흐름의 부족으로 인해 채무를 불이행할 경우, 투자자금에 대한 이자와 원금의 손실이 발생할 수 있는 위험 또는 투자자금에 대한 이자와 원금의 회수완료 시간이 예상보다 길게 소요됨에 따른 기회비용이 발생할 수 있는 위험을 말하는 것입니다.
주식등 가격변동위험 (시장위험)	주식시장은 시장 내의 수급과 시장 외부변수에 따라 그 등락을 거듭합니다. 그 중에서도 경제성장률, 환율, 금리 변동 등의 요인들은 개별기업 성과의 좋고 나쁨에 상관없이 주식시장 전체에 영향을 끼쳐 개별주식가격의 등락을 초래하게 되므로, 주식시장에 투자하는 투자자에게는 예상하기 어려운 위험이기도 합니다. 이러한 외부변수들의 변화는 투자자산 가치의 변화를 초래할 수 있습니다.
주식등 가격변동위험 (종목위험)	개별주식은 해당기업의 수익성 및 성장성의 변화에 따라 주식의 가격이 변동되므로 이에 따라 이익 혹은 손실이 발생할 가능성이 항상 있습니다. 회사는 투자대상 기업의 성장성과 수익성이 개선될 것으로 예상하거나, 기업의 가치보다 현재 시장에서 거래되는 가격이 낮다고 판단할 경우에 해당 주식을 매수하지만, 회사의 판단이 항상 정확할 수는 없는 것이므로 투자손실의 위험이 항상 존재합니다.

금리변동위험	금리변동위험 채권의 가격은 이자율에 의해 결정됩니다. 일반적으로 이자율이 하락하면 채권가격의 상승으로 인한 자본이득이 발생하고 이자율이 상승하면 채권가격의 하락으로 자본손실이 발생합니다. 따라서 채권을 만기까지 보유하지 않고 중도에 매도하는 경우에는 시장상황에 따라 손실 또는 이득이 발생할 수 있습니다. 또한 채권의 가격은 채권의 만기 이전에 발생하는 이자수령액이 현재의 채권시장 이자율과 같은 이자율로 재투자된다는 가정 하에 계산됩니다. 그러나 실제로는 채권시장 이자율이 항상 변하고 있어, 만일 이자 수령 시의 시장이자율이 당초의 시장이자율보다 낮아질 경우 채권투자로부터 발생하는 수익이 예상수익보다 작아질 수도 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 헷지전략과 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.
회사채 투자위험	회사채는 국공채 및 통안채에 비하여 높은 수준의 투자위험을 지니고 있으며, 따라서 회사채에 주로 투자하는 회사채형 투자신탁의 경우 국공채 등에 주로 투자하는 채권형 투자신탁보다 투자위험이 높음을 유의하시기 바랍니다.

**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**

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

**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
해당사항 없음							

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

## 공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 단기국공채 공모주 증권 투자신탁 제1호(채권혼합)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 신한은행의 확인을 받아 판매회사인 IBK투자증권, 기업은행, 신한은행, 우리은행, 유안타증권, 키움증권, 하나은행, 한국투자증권을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 마이다스에셋자산운용(주)  
금융투자협회

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

02-3787-3500