

자산운용보고서

마이다스 뉴베스트트리오 증권 투자신탁(주식)(운용)

(운용기간 : 2023년04월26일 ~ 2023년07월25일)

○ 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 운영하는 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 뉴베스트트리오 증권 투자신탁(주식)(운용) 마이다스 뉴베스트트리오 증권 투자신탁(주식)A1 | 2등급 | 54291 71282 | 해당하지 않음 |
| 펀드의 종류 | 투자신탁, 증권펀드(주식형), 개방형, 추가형, 종류형 | 최초설정일 | 2006.01.26 |
| 운용기간 | 2023.04.26 ~ 2023.07.25 | 존속기간 | 추가형으로 별도의 존속기간이 없음 |
| 투자소득의 과세 | <집합투자자기구> 집합투자자기구 단계에서는 별도의 소득과세 부담이 없는 것이 원칙입니다. <연금저축계좌 가입자에 대한 과세> 소득세법 시행령 제40조의2에 따른 연금저축계좌를 통해 동 투자신탁에 가입한 가입자의 경우 동 투자신탁의 수익증권을 환매하는 시점에 별도의 과세를 하지 않으며, 연금저축계좌에서 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 | 한국씨티은행 |
| 판매회사 | NH농협은행, NH투자증권, 미래에셋증권, 삼성증권, 스탠다 드차타드은행, 신한은행, 신한투자증권, 유안타증권, 유진투 자증권, 한국씨티은행, 한국투자증권 | 일반사무관리회사 | 하나펀드서비스 |
| 상품의 특징 | 이 투자신탁은 MSCI Korea Index에 포함되는 종목에 주로 투자하며, 포트폴리오의 나머지 부분은 코스피 배당 성장 50 지수 또는 KRX Governance Leaders 100에 포함되는 종목 등에 투자하여 자본이득 및 배당소득을 얻는 것을 주목적으로 합니다. | | |

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

| 펀드명칭 | 항목 | 전기말 | 당기말 | 증감률 |
|--------------------|---------------------------------|----------|----------|--------|
| 뉴베스트트리오(주식)(운용) | 자산 총액 (A) | 4,900 | 4,559 | -6.95 |
| | 부채 총액 (B) | 35 | 46 | 31.95 |
| | 순자산총액 (C=A-B) | 4,865 | 4,513 | -7.23 |
| | 발행 수익증권 총 수 (D) | 2,320 | 1,990 | -14.23 |
| | 기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000) | 2,096.98 | 2,268.26 | 8.17 |
| 종류(Class)별 기준가격 현황 | | | | |
| 뉴베스트트리오(주식)A1 | 기준가격 | 1,167.53 | 1,257.68 | 7.72 |

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 주식형펀드로서 자산의 대부분을 주식에 투자하여 자본이득과 배당소득을 얻는 것을 목적으로 합니다. 이 투자신탁은 투자목적의 달성을 위하여 국내 주식에 집합투자재산의 80% 이상을 투자하며, 투자전략은 다음과 같습니다. MSCI Korea Index 에 포함되는 종목에 주로 투자하며, 포트폴리오의 나머지 부분은 코스피 배당성장 50 지수 또는 KRX Governance Leaders 100에 포함되는 종목 등에 투자하며, 주식투자과 관련하여 적극적인 매매전략을 구사합니다.

2. 위험관리

이 투자신탁은 국내 주식에 주로 투자하는 주식형 투자신탁으로 주식 및 관련파생상품의 가격변동에 의한 손실 위험에 노출됩니다 개별 주식, 파생상품의 가격 변동으로 인한 위험을 제한하기 위하여 동일 종목 투자한도 및 파생상품에 대한 투자한도를 두고 있습니다.

3. 수익구조

이 투자신탁은 국내 주식에 주로 투자하는 주식형 투자신탁으로, 투자대상 주식의 가격 등락이 투자 손익을 결정하는 주요인입니다 즉, 투자하는 주식의 가격이 상승할 경우 이익이 발생하며, 투자하는 주식의 가격이 하락할 경우 손실이 발생합니다 한편 투자대상 주식으로부터의 배당 수익, 채권 및 유동성자산 투자분에서 발생하는 이자수익도 투자신탁 수익의 일부를 구성합니다.

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

펀드 수익률은 A1클래스 기준 7.72%로 비교지수 대비 1.80%p 높은 수준을 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용 계획

동 기간 KOSPI는 5.92% 상승하였습니다.

4월 KOSPI는 전월말 대비 1.0% 상승한 2501.53pt를 기록하였습니다(4/28일기준). 삼성전자의 메모리 반도체 감산에 대한 결정과 더불어, 이차전지 소재 사업의 성장에 대한 기대감이 증폭되며 시장은 상승하는 추세를 보였습니다. 그러나 한·중 갈등 악화에 대한 우려와 CFD 계좌 발(發) 반대 매매 우려 등으로 인해상승폭을 일부 반납하며 마감하였습니다.

5월 KOSPI는 전월말 대비 3.0% 상승한 2577.12pt를 기록하였습니다(5/31일기준). 미국 부채한도 협상의 불확실성에도 불구하고, 키옥시아-WD 합병 논의소식과 엔비디아 실적 호조 등으로 반도체주가 강세를 보이며 시장은 상승하였습니다.

6월 KOSPI는 전월말 대비 0.5% 하락한 2564.28pt를 기록하였습니다. 시장은 하반기 기업들의 실적 턴어라운드 기대감을 크게 반영하며 강세를 보였지만, 밸류에이션 부담 등으로 인한 차익 실현 매물이 출회되며 상승폭을 일부 되돌렸습니다. 6월 FOMC 이후 파월 의장이 연내 추가 금리 인상 가능성을 시사하였고, 이러한 FED의 통화정책 불확실성 또한 지수 조정 요인으로 작용하였습니다.

7월 KOSPI는 미국 6월 CPI 상승률 둔화와 경제 연속록 기대감에 따라 글로벌 위험선호 심리가 개선됨에 따라 상승하는 모습을 보이고 있습니다. 또한, 엔비디아 신고가 및 AI 산업 성장 기대감에 따른 반도체/HBM 관련주가 강세를 보이고 있습니다. 2차전지 및 양극재 관련주에 대한 개인 선호 확대 등도 상승 요인으로 작용하였습니다. 7월 FOMC에서 금리는 예상대로 25bp 인상되었으나, 향후 정책은 경제지표에 따라 결정될 것(data dependent)이라는 모호한 발언과 함께 일본의 유동성 축소 가능성, 미국의 신용등급 강등 등으로 매크로적인 불확실은 커진 환경입니다. 바텀업 측면에서는 삼성전자 및 SK하이닉스가 실적을 발표하였으나, 그 개선 속도가 과거에 보았던 것보다 느려 KOSPI의 빠른 이익 개선세를 기대하기 어려운 상황입니다. 불확실한 매크로하에서 외국인이 8월초 선물을 대량 매도하는 가운데, 수급을 개선시킬만한 어닝도 부진하기 때문에 시장은 당분간 지지부진한 모습을 보여줄 것으로 예상됩니다. 거래량, 가격레벨, 밸류에이션, 밈의 정도, 개인의 시장 참여를 보았을 때 큰 틀에서 배터리의 상승은 대부분 마무리 되었다는 판단으로 7월 펀드 보유 비중의 많은 부분을 매도하였으며 하반기 주도 섹터는 아닐 것으로 판단합니다. 이에 따라 펀드에 가용자금이 생긴가운데, 신규 섹터와 종목군들을 지속적으로 편입할 예정입니다. 반도체는 기관 투자자들이 이미 많이 매수한 상황이지만 감산 이외에 어닝 증가세가 아직 나오지 않아 섹터는 여전히 우상향에 있다는 판단입니다. 하지만 그 회복세가 기대에 상당히 미치지 못하고 있어 상승의 기울기에 대한 기대치를 상당히 낮춰서 투자해야 할 것으로 판단하고 투자 목표 기간을 좀 더 늘려야 할 것으로 계획하고 있습니다. 하반기 금리 인상이 일단락되고 매크로에 대한 우려가 점증될수록 제약, 바이오는 상대적으로 시장을 더 아웃퍼폼 할 것으로 예상되며 종목군들이 바닥에서 한번씩 반등은 한 상황이지만 추세에 배팅하여 매수할 계획입니다.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %, %p)

| 구분 | 최근 3개월 | 최근 6개월 | 최근 9개월 | 최근 12개월 |
|-----------------|--------|--------|--------|---------|
| 뉴베스트트리오(주식)(운용) | 8.17 | 13.61 | 24.04 | 15.02 |
| (비교지수 대비 성과) | (2.25) | (5.05) | (6.08) | (5.34) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 뉴베스트트리오(주식)A1 | 7.72 | 12.68 | 22.51 | 13.10 |
| (비교지수 대비 성과) | (1.80) | (4.12) | (4.55) | (3.42) |
| 비교지수(벤치마크) | 5.92 | 8.56 | 17.96 | 9.68 |

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI X 100%

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

| 구분 | 최근 1년 | 최근 2년 | 최근 3년 | 최근 5년 |
|-----------------|--------|--------|---------|---------|
| 뉴베스트트리오(주식)(운용) | 15.02 | -11.37 | 34.09 | 27.51 |
| (비교지수 대비 성과) | (5.34) | (7.62) | (14.27) | (11.52) |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 뉴베스트트리오(주식)A1 | 13.10 | -14.38 | 27.43 | 17.12 |
| (비교지수 대비 성과) | (3.42) | (4.61) | (7.61) | (1.13) |
| 비교지수(벤치마크) | 9.68 | -18.99 | 19.82 | 15.99 |

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI X 100%

※ 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 | 252.23 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 1.03 | 0.18 | 253.44 |
| 당기 | 388.80 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.81 | 0.00 | 389.61 |

3. 자산현황

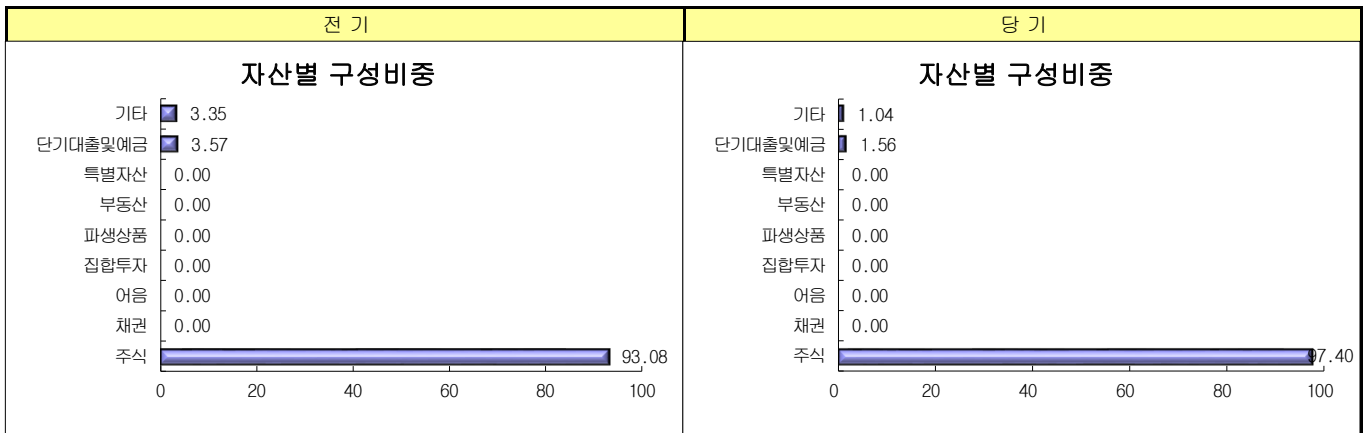
▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

| 통화별 구분 | 증권 | | | | 파생상품 | | 부동산 | 특별자산 | | 단기대출및 예금 | 기타 | 자산총액 |
|-----------|---------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|-------------|--------|----------|
| | 주식 | 채권 | 어음 | 집합투자 | 장내 | 장외 | | 실물자산 | 기타 | | | |
| KRW | 4,441 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 71 | 47 | 4,559 |
| (1.00) | (97.40) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (0.00) | (1.56) | (1.04) | (100.00) |
| 합계 | 4,441 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 71 | 47 | 4,559 |

* (): 구성 비중

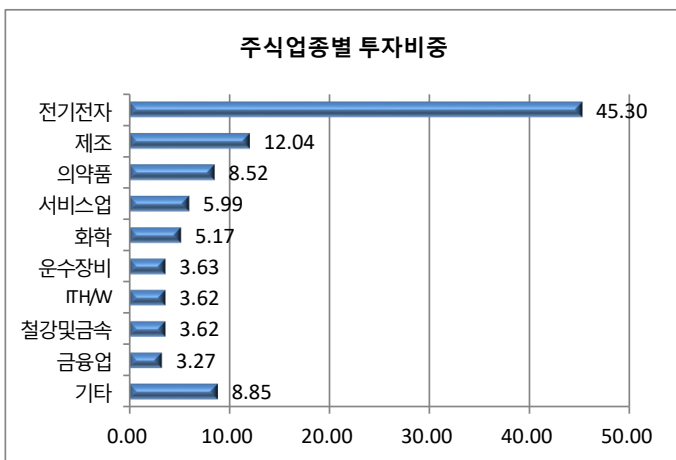
주) 위 자산구성현황의 자산총액에는 채권담보 및 미수입금 평가액을 포함하지 않습니다



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

| 순위 | 업종명 | 비중 | 순위 | 업종명 | 비중 |
|----|------|-------|----|--------|------|
| 1 | 전기전자 | 45.30 | 6 | 운수장비 | 3.63 |
| 2 | 제조 | 12.04 | 7 | IT H/W | 3.62 |
| 3 | 의약품 | 8.52 | 8 | 철강및금속 | 3.62 |
| 4 | 서비스업 | 5.99 | 9 | 금융업 | 3.27 |
| 5 | 화학 | 5.17 | 10 | 기타 | 8.85 |



주) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

| 구분 | 종목명 | 비중 | 구분 | 종목명 | 비중 | | |
|----|-----|----------|-------|-----|----|---------|------|
| 1 | 주식 | 삼성전자 | 21.23 | 6 | 주식 | 셀트리온 | 2.85 |
| 2 | 주식 | SK하이닉스 | 9.28 | 7 | 주식 | LG화학 | 2.61 |
| 3 | 주식 | LG에너지솔루션 | 5.95 | 8 | 주식 | 삼성SDI | 2.51 |
| 4 | 주식 | 삼성바이오로직스 | 4.42 | 9 | 주식 | 제이시스메디칼 | 2.50 |
| 5 | 주식 | POSCO홀딩스 | 3.52 | 10 | 주식 | 포스코퓨처엠 | 2.32 |

※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 |
|----------|--------|------|-------|------|-----|-------|----|
| 삼성전자 | 13,831 | 968 | 21.23 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| SK하이닉스 | 3,730 | 423 | 9.28 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| LG에너지솔루션 | 457 | 271 | 5.95 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| 삼성바이오로직스 | 274 | 201 | 4.42 | 대한민국 | KRW | 의약품 | |
| POSCO홀딩스 | 244 | 161 | 3.52 | 대한민국 | KRW | 철강및금속 | |
| 셀트리온 | 899 | 130 | 2.85 | 대한민국 | KRW | 의약품 | |
| LG화학 | 164 | 119 | 2.61 | 대한민국 | KRW | 화학 | |
| 삼성SDI | 161 | 115 | 2.51 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |
| 제이시스메디칼 | 10,170 | 114 | 2.50 | 대한민국 | KRW | 제조 | |
| 포스코퓨처엠 | 177 | 106 | 2.32 | 대한민국 | KRW | 전기전자 | |

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

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 | |
| 이광희 | 차장 | 38 | 11 | 11,877 | 17 | 24,383 | 2112000857 |

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 |
|--|------------|
| 2021.10.21 ~ 현재 2016.07.21 ~ 2021.10.20 | 이광희 홍성철 |

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

| 구분 | 전기 | | 당기 | |
|-------|----|------|----|------|
| | 금액 | 비율 | 금액 | 비율 |
| 자산운용사 | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |

| | | | | | | |
|-----------------|----------------|------------------|------|------|------|------|
| 뉴베스트트리오(주식)(운용) | 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** | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 |
| | 매매, 중개 수수료 | 단순매매·중개수수료 | 1 | 0.01 | 1 | 0.01 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 2 | 0.03 | 1 | 0.03 |
| | | 합계 | 2 | 0.04 | 2 | 0.04 |
| | 증권거래세 | | 3 | 0.05 | 3 | 0.05 |
| | 뉴베스트트리오(주식)A1 | 자산운용사 | | 8 | 0.16 | 8 |
| 판매회사 | | 12 | 0.25 | 12 | 0.25 | |
| 펀드재산보관회사(신탁업자) | | 0 | 0.01 | 0 | 0.01 | |
| 일반사무관리회사 | | 0 | 0.00 | 0 | 0.01 | |
| 보수합계 | | 21 | 0.42 | 20 | 0.42 | |
| 기타비용** | | 0 | 0.00 | 0 | 0.00 | |
| 매매, 중개 수수료 | | 단순매매·중개수수료 | 1 | 0.01 | 1 | 0.01 |
| | | 조사분석업무 등 서비스 수수료 | 2 | 0.03 | 1 | 0.03 |
| | | 합계 | 2 | 0.04 | 2 | 0.04 |
| 증권거래세 | | 3 | 0.05 | 3 | 0.05 | |

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

| | | 총보수·비용비율(A) | 매매·중개수수료 비율(B) | 합계(A+B) |
|-----------------|----|-------------|----------------|---------|
| 뉴베스트트리오(주식)(운용) | 전기 | 0 | 0.1779 | 0.1779 |
| | 당기 | 0 | 0.1764 | 0.1764 |
| 종류(Class)별 현황 | | | | |
| 뉴베스트트리오(주식)A1 | 전기 | 1.7021 | 0.1783 | 1.8804 |
| | 당기 | 1.7019 | 0.1768 | 1.8787 |

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평균잔액(보수·비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수·비용수준을 나타냅니다.

주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평균잔액(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 |
| 15,397 | 790 | 26,659 | 1,293 | 27.80 | 111.51 |

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

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

(단위 : %)

| 2022년10월26일 ~ 2023년01월25일 | 2023년01월26일 ~ 2023년04월25일 | 2023년04월26일 ~ 2023년07월25일 |
|---------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 30.00 | 27.75 | 27.80 |

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. |
| 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 이익이 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 구사함에 불구하고, 파생상품은 시장 내의 수급과 시장 외부변수에 따라 기초자산의 움직임과 상이하게 움직일 경우 파생상품에 투자하는 투자자에게 예상하기 어려운 투자자산 가치의 변화를 초래할 수 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. RP거래의 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 있습니다. 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. |
| 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 |
|---------|----|-----|-----|-----|-----|------|-----|
| 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 뉴베스트트리오 증권 투자신탁(주식)(운용)의 자산운용회사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 한국씨티은행의 확인을 받아 판매회사인 NH농협은행, NH투자증권, 미래에셋증권, 삼성증권, 스탠다드차타드은행, 신한은행, 신한투자증권, 유안타증권, 유진투자증권, 한국씨티은행, 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

고객님이 가입하신 펀드는 펀드의 운용규모가 법적 기준 소규모상태(50억원 미만)에 해당하여 운용시 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)