

자산운용보고서

마이애셋법인MMF1호

(운용기간 : 2009년10월08일 ~ 2009년11월07일)

o 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 집합투자업자가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(1개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다.

마이애셋자산운용(주)

서울 영등포구 여의도동 25-5 동화빌딩 6층
(전화 02-3774-6114, <http://www.mai.co.kr>)

목 차

- 1 집합투자기구의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 운용계획
 - ▶ 기간수익률
 - ▶ 연평균 수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 책임운용전문인력
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전을
 - ▶ 중개회사별 거래내역
- 7 이해관계인과의 거래 및 계열회사 발행증권 거래현황
 - ▶ 이해관계인과의 거래
 - ▶ 계열회사 발행증권 보유현황 및 비율
 - ▶ 계열회사 발행증권 거래내역
 - ▶ 계열회사 발행증권 대차거래 내역
- 8 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사여부 및 그 내용

1. 집합투자기구의 개요

▶ 기본정보

적용법률 : 자본시장법(간투법에서 전환)

위험등급 : 5등급

집합투자기구 명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이애셋법인MMF1호		82681	
집합투자기구의 종류	투자신탁, 단기금융(MMF), 개방형, 추가형	최초설정일	2008.05.08
운용기간	2009.10.08 ~ 2009.11.07(1개월간)	존속기간	추가형
신탁업자	우리은행	일반사무관리회사	외환펀드서비스
투자매매·중개업자	금호증권,대신증권,유진투자증권,하이투자증권		
상품의 특징	<ul style="list-style-type: none"> ■ 투자신탁채산을 채권 및 기업어음(만기 1년 이하)과 단기 금융상품에 투자함으로써 안정적 수익창출을 목적으로 하는 실적배당형 상품으로 수시 입출금(익일설정/익일환매)이 가능한 법인전용 MMF입니다. ■ 운용자산의 가중평균 잔존만기는 90일 이하로 제한되며 채권 및 기업어음의 투자한도는 취득시점 기준 신용평가기관의 신용평가등급이 최상위등급(5%) 또는 차하위등급(2%) 이내로 운용됩니다. 		

▶ 재산현황

(단위 : 백만원, 백만좌, %)

집합투자기구명칭	항목	전기말	당기말	증감률
마이법인MMF1호	자산 총액 (A)	30,115	167,615	456.59%
	부채 총액 (B)	6	8	30.16%
	순자산총액 (C=A-B)	30,108	167,606	456.68%
	발행 수익증권 총 수 (D)	29,806	165,659	455.78%
	기준가격(주) (E=C/D×1000)	1,010.12	1,011.75	0.16%

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

전월 금리 동향:
미국 채권시장은 10월 중순에 10년물 금리 고점 3.55%, 저점 3.17% 사이에서 박스권장세를 유지하였으나, 월말 입찰호조 및 FRB의 금리 동결 등에 힘입어 금리가 하향 안정되는 모습을 보였습니다. 국내 채권시장은 단기금리 지표인 CD(3개월)금리는 일정한 모습을 보였으나, 국채 3년물 금리의 경우, 3분기 GDP 속보치가 예상을 크게 상회하면서 연중 고점인 4.62%까지 상승했습니다. 하지만 그 후 시장은 4/4분기 경기회복 속도가 둔화될 것이며 금리상승이 선 반영되었다는 인식에 따라 4.4%로 하향 안정되었습니다.

운용성과:
단기금리 상승에 대비하여 채권 보유비중을 줄이고 우량 기업어음 비중을 유지하면서 적극적인 RP운용으로 수익률 및 자산건전성 제고를 위해 노력하였습니다. 수익률 측면에서는 펀드 설정액 증가, 3/4분기 GDP호조로 금리가 큰 변동성을 보임에 따라 펀드 유동성을 확보하며 우량 기업어음 위주로의 선별적 종목선정 및 편입으로 안정적인 수익률유지에 주력하였습니다. ('09.11.7일 현재 일일 수익률: 2.15%)

▶ 운용 계획

11월 금융통화위원회에서 기준금리 인상 시기를 내년 1/4분기 이후로 암시하면서 단기금리가 하향 안정되는 모습을 보임에 따라 만기 3개월 내외의 은행채, 우량 CP 및 3개월, 6개월 정기예금 편입으로 안정적인 이자수익을 확보하고, 시장의 자금 수급 및 금리전망에 대한 분석 예측 능력을 강화하여 능동적인 듀레이션 조절로 자본이익을 얻으며 괴리를 관리에 힘쓸 예정입니다. 또한 유동성 자금의 적극적 RP운용을 통해 펀드 수익률을 개선할 예정입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
마이법인MMF1호	0.57	1.17	1.83	3.24
비교지수(벤치마크)	0.65	1.20	1.70	3.48

주) 비교지수(벤치마크) : 3개월 동안채 수익률 50% + Call Rate 50%

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

▶ 연평균 수익률

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이법인MMF1호	3.24	-	-	-
비교지수(벤치마크)	3.48	-	-	-

주) 비교지수(벤치마크) : 3개월 동안채 수익률 50% + Call Rate 50%

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위 : 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일
정기예금	하나은행	2009-11-05	10,000	3.10	2010-02-05
RP	메리츠증권	2009-11-06	10,000	2.50	2009-11-26
RP	대신증권	2009-11-05	10,000	2.40	2009-11-26
정기예금	광주은행	2009-11-06	10,000	3.15	2010-02-05
단기대출	신한은행	2009-11-06	61,600	1.94	2009-11-09
단기대출	금호증권	2009-11-06	10,000	2.10	2009-11-09

주) 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 책임운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위 (연령)	운용중인 다른 집합투자기구 현황		주요 경력 및 운용실적(최근5년)	협회등록번호
			집합투자기 구의 수	운용 규모		
김상근	2008-05-08	팀장 (44)	15	530,900	- SEI에셋코리아 채권운용팀 - 한외종합금융 투자팀 - 마이애셋우량증권모투자신탁(채권)	03-02011-0025

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, '책임 운용전문인력'이란 운용전문인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함

※ 성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모 : 1개, 42,200백만원

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위 : 백만원, %)

	구분	전기		당기	
		금액	비율	금액	비율
마이법인MMF1호	집합투자업자	1	0.00	1	0.00
	투자매매·중개업자	1	0.00	3	0.01
	신탁업자	0	0.00	1	0.00
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
	보수합계	3	0.01	6	0.02

* 집합투자기구의 순자산총액 대비 비율

※ 성과보수내역 : 없음

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

	구분	해당 집합투자기구	
		총보수·비용비율	중개수수료 비율
마이법인MMF1호	전기	0.156	0.0037
	당기	0.1567	0.0039

주) 총보수.비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 집합투자기구에서 부담하는 '보수'와 기타비용 총액을 순자산 연평균액(보수.비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총 보수.비용수준을 나타냄. 또한 모자형의 경우 상위 집합투자기구에서 발생한 비용을 하위 집합투자기구가 차지하는 비율대로 안분하여, 합산(합성 총보수.비용비율)하여 보여 줌

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

▶ 중개회사별 거래내역

알림) 비관계회사는 상위 1개사만을 명시합니다.

■ 주식

(단위 : 백만원, %)

구분	회사명	09-08-08 ~ 09-09-07			09-09-08 ~ 09-10-07			09-10-08 ~ 09-11-07		
		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료	
			금액 (비중)	수수 료율		금액 (비중)	수수 료율		금액 (비중)	수수 료율
해당없음										

* 주식의 총 거래금액 및 수수료에 대한 중개회사별 비중

■ 그밖의 증권

(단위 : 백만원, %)

구분	회사명	(9월)09-08-08 ~ 09-09-07			(10월)09-09-08 ~ 09-10-07			(11월)09-10-08 ~ 09-11-07		
		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료	
			금액 (비중)	수수 료율		금액 (비중)	수수 료율		금액 (비중)	수수 료율
비관계회사	외환은행(종금부)	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	0 (0.00)	0 (0.00)	0.00	34,819 (34.52)	0 (0.00)	0.00

* 그밖의 증권 거래금액 및 수수료에 대한 중개회사별 비중

■ 파생상품

(단위 : 백만원, %)

구분	회사명	09-08-08 ~ 09-09-07			09-09-08 ~ 09-10-07			09-10-08 ~ 09-11-07		
		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료		거래금액 (비중)	수수료	
			금액 (비중)	수수 료율		금액 (비중)	수수 료율		금액 (비중)	수수 료율
해당없음										

* 파생상품의 총 거래금액 및 수수료에 대한 중개회사별 비중

7. 이해관계인과의 거래 및 계열회사 발행증권 거래 현황

▶ 이해관계인과의 거래

(단위: 백만원, %)

이해관계인		거래일자	거래종류	자산의 종류	거래금액	비고
성명(상호)	관계					
해당없음						

▶ 계열회사 발행증권 보유현황 및 비율

단위 : 주, 백만원, %

◆ 해당집합투자기구

종목명	보유수량	보유금액(평가금액)	보유비율
해당없음			

◆ 전체집합투자기구

단위 : 주, 백만원, %

자산의 종류	보유수량	보유금액(평가금액)	보유비율
해당없음			

▶ 계열회사 발행증권 거래 내역

거래구분	자산의 종류	종목명	매매방법 (거래상대방)	거래수량	거래금액	거래일자
해당없음						

▶ 계열회사 발행증권 대차거래 내역

종목명	구분	거래상대방	거래금액	거래조건	거래일시
해당없음					

8. 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사여부 및 그 내용

회사명	주주총회일	보유주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)			불행사의 경우 그 사유
				찬성	반대	불행사	
계열회사							
<거래소>							

	해당없음
<코스닥>	
	해당없음
<해외시장>	
	해당없음
비계열회사	
<거래소>	
	해당없음
<코스닥>	
	해당없음
<해외시장>	
	해당없음

※ 중립적 의견권 행사 중목

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이애셋법인MMF1호의 집합투자업자인 '마이애셋자산운용(주)'이 작성하여 신탁업자인 '우리은행'의 확인을 받아 투자매매.중개업자인 '금호증권,대신증권,유진투자증권,하이투자증권'을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 집합투자기구의 신탁업자 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이애셋자산운용(주) <http://www.mai.co.kr> / 02-3774-6114
금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>