

자 산 운 용 보 고 서

1. 집합투자기구의 개요

▶ 기본정보

『적용법률: 자본시장법(신규 설정)』

위험등급 : 1등급

집합투자기구명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)		93983	
집합투자기구의 종류	투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형	최초설정일	2009-04-20
운용기간	3개월(2009-04-20 ~ 2009-07-19)	존속기간	추가형
신탁업자	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC제일펀드서비스
투자매매·중개업자	한양증권 하나대투증권 대우증권 대구은행 NH투자증권(세종) 솔로몬투자증권		
상품의 특징	이 투자신탁은 주식형펀드로서 약관상 주식에 60%이상 투자하고 있으며, 주식 투자시 재무적 기업평가 방식과 비재무적 기업평가 방식(그린산업/SRI)을 함께 활용하여 투자대상 종목을 선정, 투자하여 종합주가지수 이상의 수익을 얻는 것을 주목적으로 합니다.		

☞ 위험등급 : 투자대상 자산의 종류 및 위험도 등을 감안하여 1등급(매우 높은 위험) 부터 5등급(매우 낮은 위험) 까지 투자위험 등급을 5단계로 분류함.

☞ 1등급 - 매우 높은 위험, 2등급 - 높은 위험, 3등급 - 중간 위험, 4등급 - 낮은 위험, 5등급 - 매우 낮은 위험

▶ 재산현황

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	-	1,433,132,159	-
부채 총액 (B)	-	28,435,003	-
순자산총액 (C=A-B)	-	1,404,697,156	-
발행 수익증권 총 좌수 (D)	-	1,275,802,964	-
기준가격 (E=C/D*1000)	-	1,101.03	-

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이다스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	-	86,101,354	-
부채 총액 (B)	-	243,630	-
순자산총액 (C=A-B)	-	85,857,724	-
발행 수익증권 총 좌수 (D)	-	78,284,469	-
기준가격 (E=C/D*1000)	-	1,096.74	-

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이다스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	-	1,313,775,964	-
부채 총액 (B)	-	5,471,237	-
순자산총액 (C=A-B)	-	1,308,304,727	-
발행 수익증권 총 좌수 (D)	-	1,194,785,013	-
기준가격 (E=C/D*1000)	-	1,095.01	-

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이다스 그린SRI 증권투자신탁C6(주식)	전기말	당기말	증감률

자산 총액 (A)	-	5,224,350	-
부채 총액 (B)	-	12,343	-
순자산총액 (C=A-B)	-	5,212,007	-
발행 수익증권 총 좌수 (D)	-	4,757,146	-
기준가격 (E=C/D*1000)	-	1,095.62	-

* 기준가격이란 투자신탁의 순자산총액을 발행된 수익증권 총 좌수로 나눈 가격으로 수익증권의 매입 및 환매시 적용되는 가격임.

▶ 분배금 지급내역

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 지급일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
해당사항 없음					

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 10.10%이며 종합주가지수는 8.36% 상승하여 비교지수 대비 1.74% 초과수익을 기록하였습니다. 동 기간 동안 업종별로는 철강, 자동차, 은행, IT업종에 주식편입비중을 높였고 건설, 해운, 증권업종의 편입비중을 낮추었습니다. 비교지수대비 높은 수익률을 기록한 이유는 양호한 수익률을 기록했던 은행, IT업종의 편입비중이 높았던 점입니다. 종목별로는 현대제철, 호남석유, 대림산업, JS전선, 현대차, KB금융, 대구은행, 하이닉스 등이 펀드 수익률에 긍정적인 영향을 미쳤으며 SK에너지, KCC, 현대중공업, 두산 등 화학 및 기계업종의 일부 종목들이 펀드 수익률에 부정적 영향을 주었습니다. 편입종목의 변경 내용은 현진소재, 금호산업, 대한전선, 한진해운, 경동나비엔, NH투자증권, 삼성테크윈 등의 종목을 분기초기에 포트폴리오에 편입하였다가 수익률 달성 및 기업이익 추정치의 부정적 변화 등을 이유로 포트폴리오에서 제외하였습니다.

▶ 운용계획

각국 정부들의 정책 대응의 성공적 진행으로 세계경제는 바닥을 탈피하고 있습니다. 특히 국내경제와 밀접한 중국경제의 성장은 놀라운 수준이며, 국내경제 또한 적극적인 정부정책의 효과로 기대이상의 회복속도를 보여주고 있습니다. 국내 경제의 또 하나의 중요한 축인 미국 경제 또한 서서히 바닥을 통과하고 있다는 점도 중기적으로 긍정적인 요인입니다. 국내기업들은 IT, 자동차 업종을 중심으로 글로벌 경쟁력 강화와 함께 놀라운 2분기 실적을 달성하여 연간 이익전망을 상향시키고 있습니다. 한편 경제지표가 개선되고 증시가 상승할수록 과도한 유동성의 회수 가능성에 대한 우려는 커질 것으로 전망됩니다.

▶ 기간수익률

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	3.32	10.10			
비교지수	4.10	8.36			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	3.19	9.67			
비교지수					

비교지수(Bench Mark) = 없음

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	3.14	9.50			
비교지수					

비교지수(Bench Mark) = 없음

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	3.16	9.56			
비교지수					

비교지수(Bench Mark) = 없음

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

▶ 연평균 수익률

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년

집합투자기구				
비교지수				

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구				
비교지수				

비교지수(Bench Mark) = 없음

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구				
비교지수				

비교지수(Bench Mark) = 없음

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

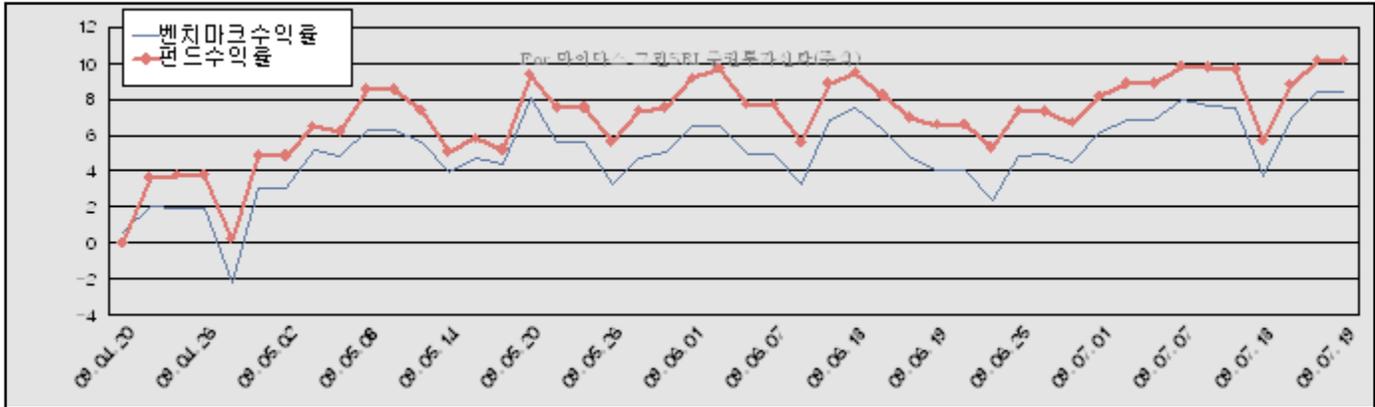
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구				
비교지수				

비교지수(Bench Mark) = 없음

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

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)



비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

▶ 손익현황

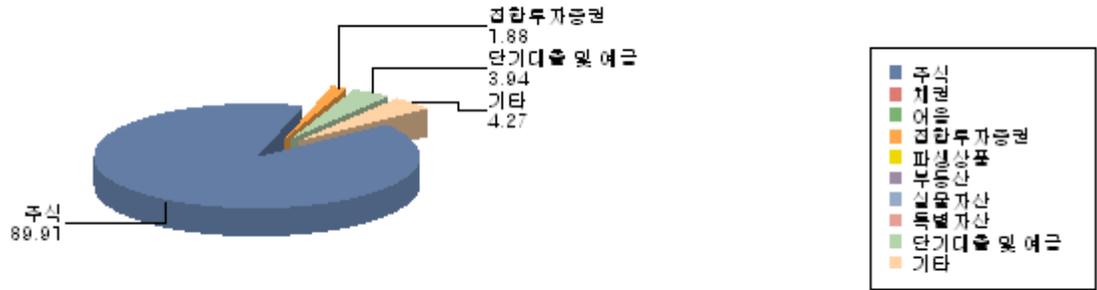
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	40	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-2	39
전기손익	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0

3. 자산현황

▶ 자산구성현황



마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원,%)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	1,289 (89.91)	0 (0.00)	0 (0.00)	27 (1.88)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	56 (3.94)	61 (4.27)	1,433 (100.00)
합계	1,289 (89.91)	0 (0.00)	0 (0.00)	27 (1.88)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	56 (3.94)	61 (4.27)	1,433 (100.00)

※ ()내는 자산총액에 대한 비중

▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	11.55	2	주식	POSCO	6.28
3	단기대출및예금	예금	3.94	4	주식	LG전자	2.99
5	주식	KB금융	2.81	6	주식	KT	2.70
7	주식	한국전력	2.60	8	주식	신한지주	2.27
9	주식	현대차	2.25	10	주식	현대중공업	2.23

▶ 주식

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	247	165,490,000	12.84
POSCO	200	90,000,000	6.98
LG전자	336	42,840,000	3.32
KB금융	800	40,240,000	3.12
KT	1,038	38,665,500	3.00

※ 상위 5개 종목만 기재함. ※ 비중 : 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

※ 상위 5개 종목만 기재함. ※ 비중 : 채권 총액중 해당 종목이 차지하는 비중.

▶ 어음

(단위 : 원,%)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

※ 상위 5개 종목만 기재함. ※ 비중 : 어음 및 채무증서 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ **집합투자증권**

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 원)

종목	취득일자	취득가액	평가액	비고
KODEX 200	2009-06-23	25,214,630	26,969,800	

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ **장내파생상품**

(단위 : 계약,원)

종목	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
해당사항 없음				

▶ **장외파생상품**

(단위 : 원)

종류	거래상대방	기초자산	매수/매도	만기일	계약금액	취득가격	평가금액	비고
해당사항 없음								

▶ **부동산(임대)**

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가격	보증금	비고
	등기번호	취득일	평가금액	임대수입	
해당사항 없음					

▶ **부동산(자금대여 및 차입)**

(단위 : 원,%)

종류	대여(차입)기관	계약일자	대여(차입)금액	대여(차입)금리	만기(상환)일	비고
해당사항 없음						

▶ **특별자산 (실물자산)**

(단위 : 원)

종류	취득일자	취득가격	평가금액	비고
해당사항 없음				

▶ **단기대출 및 예금**

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 원,%)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	한국씨티은행		56,453,121			

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ **기타**

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	60,324,768	
미수배당금	803,750	
합계	61,128,518	

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 책임운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위 (연령)	운용중인 다른 집합투자기구 현황		주요 경력 및 운용실적(최근5년)	협회등록번호
			기구 수	운용 규모		
허필석	2009-04-20	대표이사 1967년	11	1,144,101	서울대학교 대학원 경영학 석사, KAIST Techno MBA, 미국 일리노이대학 금융공학과정 연수, CFA장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부현 마이다스에셋 자산운용(주) 주식운용본부장 주요운용펀드 : 마이다스블로칭배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	운용역 1976년	11	1,144,101	성균관대학교 경제학과, 대우증권 고유계정운용, 유리자산운용 주식운용. 현 마이다스에셋자산운용	08-02002-0043

※ 성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모 : 펀드수(5) 운용규모(195,838)

5. 비용현황

▶ 업자별 보수 지급현황

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
집합투자업자	0	0.00	0	0.00	
투자매매/중개업자	0	0.00	0	0.00	
신탁업자	0	0.00	0	0.00	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	0	0.00	0	0.00	

마이다스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
집합투자업자	0	0.00	0	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.00	0	0.22	
신탁업자	0	0.00	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	0	0.00	0	0.40	

마이다스 그린SRI 증권투자신탁C(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
집합투자업자	0	0.00	1	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.00	3	0.38	
신탁업자	0	0.00	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	0	0.00	5	0.56	

마이다스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
집합투자업자	0	0.00	0	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.00	0	0.33	
신탁업자	0	0.00	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	0	0.00	0	0.50	

※ 집합투자기구의 순자산총액 대비 비율

▶ 총보수비용 비율

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	0.00	2.34
중개수수료비율	0.00	1.52

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	0.00	1.60
중개수수료비율	0.00	0.00

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	0.00	2.24
중개수수료비율	0.00	0.00

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	0.00	2.00
중개수수료비율	0.00	0.00

※ 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 집합투자기구에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔액(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

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
80,942	2,432,633,850	50,662	1,232,579,280	130.25	528.25

※ 매매회전율이란 주식매매의 빈번한 정도를 나타내는 지표로서 해당 운용기간동안 매도한 주식가액을 같은 기간동안 평균적으로 보유한 주식가액으로 나누어 산출. 해당 운용기간동안 평균적인 주식투자 규모가 100억원이고, 주식 매도금액 또한 100억원인 경우 매매회전율은 100%(일회전)임.

▶ 중개회사별 거래내역

■ 주식

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

구분	2009-04-20 ~ 2009-05-19			2009-05-20 ~ 2009-06-19			2009-06-20 ~ 2009-07-19		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	1,422 (73.48)	1.42 (72.08)	0.10	914 (88.67)	0.91 (88.66)	0.10	680 (93.85)	0.68 (93.85)	0.10

■ 그 밖의 증권

(단위 : 백만원, %)

구분	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율

■ 파생상품

(단위 : 백만원, %)

구분	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율

※ 비관계회사는 상위 1개사만을 명시합니다.

7. 이해관계인과의 거래 및 계열회사 발행증권 거래 현황

▶ 이해관계인과의 거래

(단위 : 백만원)

이해관계인		거래의 종류	자산의 종류	거래금액
성명(상호)	관계			
해당사항 없음				

▶ 계열회사 발행증권 보유현황 및 비율

◆ 해당집합투자기구

(단위 : 주, 원, %)

종목명	보유수량	보유(평가)금액	보유비율
해당사항 없음			

◆ 전체집합투자기구

(단위 : 주, 원, %)

자산의 종류	보유수량/액면가액	보유(평가)금액	보유비율
해당사항 없음			

▶ 계열회사 발행증권 거래 내역

(단위 : 주, 원)

거래구분	자산의 종류	종목명	거래상대방	거래수량	거래금액	거래일자
해당사항 없음						

▶ 계열회사 발행증권 대차거래 내역

(단위 : 주, 백만원)

종목명	구분	거래상대방	거래금액	거래조건	거래일자
해당사항 없음					

8. 의결권 공시대상 법인에 대한 의결권 행사 여부 및 그 내용

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)			불행사 사유
				찬성	반대	불행사	
※ 중립적 의결권 행사 종목 : 없음							

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)			불행사 사유
				찬성	반대	불행사	
※ 중립적 의결권 행사 종목 : 없음							

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)			불행사 사유
				찬성	반대	불행사	
※ 중립적 의결권 행사 종목 : 없음							

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C6(주식)

회사명	주주 총회일	보유 주식수	의안	의결권 행사내용(주식수)			불행사 사유
				찬성	반대	불행사	
※ 중립적 의결권 행사 종목 : 없음							

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)의 집합투자업자인 마이더스에셋자산운용이 작성하여 신탁업자인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 투자매매, 중개업자를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 집합투자기구의 신탁업자 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이더스에셋자산운용 <http://www.midasasset.co.kr> / 02-3787-3500
 금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>