

# 자 산 운 용 보 고 서

## 1. 집합투자기구의 개요

### ▶ 기본정보

『적용법률: 자본시장법(신규 설정)』

위험등급 : 1등급

집합투자기구명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)		93983	
집합투자기구의 종류	투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형	최초설정일	2009-04-20
운용기간	3개월(2009-07-20 ~ 2009-10-19)	존속기간	추가형
신탁업자	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC제일펀드서비스
투자매매·중개업자	한양증권 하나대투증권 대구은행 대우증권 NH투자증권 솔로몬투자증권		
상품의 특징	이 투자신탁은 주식형펀드로서 악관상 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, %)

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	1,433,132,159	2,382,394,123	66.24
부채 총액 (B)	28,435,003	44,971,341	58.15
순자산총액 (C=A-B)	1,404,697,156	2,337,422,782	66.40
발행 수익증권 총 좌수 (D)	1,275,802,964	1,822,685,668	42.87
기준가격 (E=C/D*1000)	1,101.03	1,282.41	16.47

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	86,101,354	253,097,174	193.95
부채 총액 (B)	243,630	631,769	159.31
순자산총액 (C=A-B)	85,857,724	252,465,405	194.05
발행 수익증권 총 좌수 (D)	78,284,469	198,421,738	153.46
기준가격 (E=C/D*1000)	1,096.74	1,272.37	16.01

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	전기말	당기말	증감률
자산 총액 (A)	1,313,775,964	2,073,929,839	57.86
부채 총액 (B)	5,471,237	11,403,309	108.42
순자산총액 (C=A-B)	1,308,304,727	2,062,526,530	57.65
발행 수익증권 총 좌수 (D)	1,194,785,013	1,626,075,383	36.10
기준가격 (E=C/D*1000)	1,095.01	1,268.41	15.84

(단위 : 원, 좌/주, %)

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C6(주식)	전기말	당기말	증감률
-------------------------	-----	-----	-----

자산 총액 (A)	5,224,350	12,263,608	134.74
부채 총액 (B)	12,343	37,261	201.88
순자산총액 (C=A-B)	5,212,007	12,226,347	134.58
발행 수익증권 총 좌수 (D)	4,757,146	9,628,346	102.40
기준가격 (E=C/D*1000)	1,095.62	1,269.83	15.90

\* 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(A1기준) 16.01%이며 종합주가지수 수익률은 14.51% 상승하여 종합주가지수대비 1.5%의 초과수익을 얻었습니다. 동 기간 동안 종합주가지수 대비 높은 수익률을 기록한 이유는 양호한 수익률을 기록했던 유통, 음식료, 은행, IT업종의 비중이 높았기 때문으로 분석됩니다. 종목별로는 웅진코웨이, 기아차, 오리온, 우리금융지주, 하이닉스, 삼성테크윈 등이 펀드 수익률에 긍정적인 영향을 미쳤으며 OCI, 현대산업, 대우증권, LG이노텍 등이 펀드 수익률에 부정적 영향을 주었습니다. 업종별로는 정유, 철강, 유통, 은행, IT업종의 편입비중을 높였고, 건설, 조선, 해운업종의 편입비중을 낮추었습니다. 편입종목의 변경 내용은 고려아연, KCC, 웅진코웨이, 종근당, 오리온 등을 포트폴리오에 신규 편입하였으며, 동국제강, 한국타이어, 신세계, 두산, 삼성SDI 등을 수익률 달성 및 기업이익 추정치의 부정적 변화 등을 이유로 포트폴리오에서 제외하였습니다.

### ▶ 운용계획

경기회복을 주도했던 이머징마켓 국가들에 이어 미국과 유럽의 선진국들의 경기회복 신호가 강해지고 있습니다. 이러한 경기회복을 바탕으로 선진국 증시의 추세가 견고해지고 있음에도 불구하고 국내를 포함한 일부 국가들의 출구전략에 대한 논의와 진행으로 유동성은 점차 축소될 것으로 전망되어 국내증시는 이에 따른 부정적인 영향을 선반영하고 있는 것으로 판단됩니다. 게다가 국내 경기 선행지수의 상승세 둔화와 연초 이후 진행되어온 지속상승에 대한 부담감으로 시장은 당분간 쉬어가는 장세가 예상됩니다. 따라서 업종 비중 조정과 관련해서는 업종 중립적인 균형 있는 포트폴리오를 유지할 계획입니다. 또한 중국 소비성장의 수혜주에 대한 편입비중을 늘리고, 금리인상 사이클에 대비해 신용 고위험 종목군의 편입비중을 줄일 예정입니다. 또한 이 기간 동안 내년도 이익 전망이 양호한 업종과 테마 종목군 발굴에 주력하여 변동 이후의 장세에 대한 준비에 집중할 계획입니다.

### ▶ 기간수익률

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	-3.22	16.47	28.24		
비교지수	-2.98	14.51	24.08		

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	-3.35	16.01	27.24		
비교지수	-2.98	14.51	24.08		

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	-3.41	15.84	26.84		
비교지수	-2.98	14.51	24.08		

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	-3.39	15.90	26.98		
비교지수	-2.98	14.51	24.08		

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

\* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 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) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

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

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

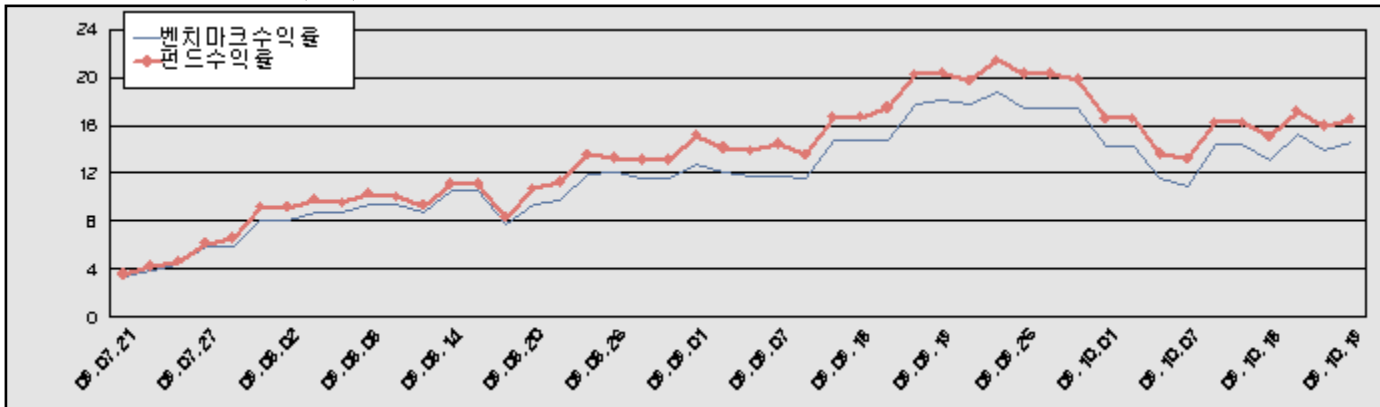
(단위 : %)

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

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

\* 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, %)

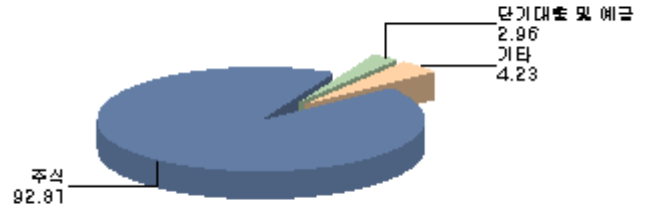
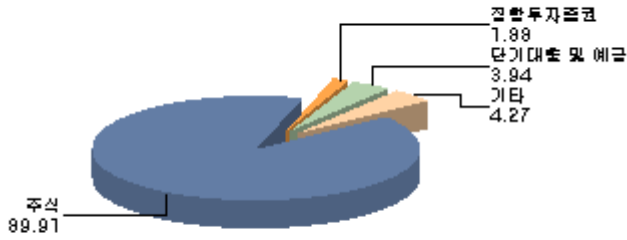
구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			
당기손익	236	0	0	0	0	0	0	0	0	0	0	237
전기손익	40	0	0	0	0	0	0	0	0	0	-1	39

### 3. 자산현황

#### ▶ 자산구성현황

[ 전기 ]

[ 당기 ]



※ 위 자산구성 그래프는 모펀드 기준의 구성현황입니다.

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	2,211 (92.81)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	71 (2.96)	101 (4.23)	2,382 (100.00)
합계	2,211 (92.81)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	71 (2.96)	101 (4.23)	2,382 (100.00)

※ ( )내는 자산총액에 대한 비중. 다만 클래스 펀드인 경우, 클래스운용펀드의 투자비중을 뜻함.

#### ▶ 투자대상 상위 10종목

##### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	12.70	2	주식	POSCO	7.54
3	주식	KB금융	3.23	4	주식	한국전력	3.00
5	단기대출및예금	예금	2.96	6	주식	우리금융	2.93
7	주식	신한지주	2.65	8	주식	KT	2.59
9	주식	기업은행	2.28	10	주식	삼성화재	2.22

#### ▶ 주식

##### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	403	302,653,000	13.69
POSCO	330	179,520,000	8.12
KB금융	1,242	76,879,800	3.48
한국전력	2,020	71,407,000	3.23
우리금융	4,280	69,764,000	3.16

※ 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 및 기타증권

(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**

(단위 : 원,%)

종목	취득일자	취득가액	평가액	비고
해당사항 없음				

※ 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		70,511,133			

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ **기타**

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	100,689,340	
합계	100,689,340	

**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	1,093,548	서울대학교 대학원 경영학 석사, KAIST Techno MBA, 미국 일리노이대학 금융공학과정 연수, CFA장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부 現 마이다스에셋 자산운용(주) 주식운용본부장 주요운용펀드 : 마이다스블록체인채권투자신탁1층(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	운용역 1976년	11	1,093,548	성균관대학교 경제학과, 대우증권 고유계정운용, 유리자산운용 주식운용. 現 마이다스에셋자산운용	08-02002-0043

※ 성과보수가 있는 펀드 및 투자일임계약 운용규모 : 펀드수(4) 운용규모(158,396)

## 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	0.16	0	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.22	0	0.23	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	0	0.40	1	0.40	

#### 마이다스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	비율	금액	비율	
집합투자업자	1	0.16	3	0.16	
투자매매/중개업자	3	0.38	7	0.39	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	5	0.56	10	0.56	

#### 마이다스 그린SRI 증권투자신탁C6(주식)

(단위 : 백만원,%)

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

※ 집합투자자기구의 순자산총액 대비 비율

### ▶ 총보수비용 비율

#### 마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수.비용비율	2.34	1.08
중개수수료비율	1.52	1.01

#### 마이다스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수.비용비율	1.60	1.60
중개수수료비율	0.00	0.00

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	2.24	2.24
중개수수료비율	0.00	0.00

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	전기	당기
총보수·비용비율	2.00	2.00
중개수수료비율	0.00	0.00

※ 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 보여줌.

## 6. 투자자산매매내역

### ▶ 매매주식규모 및 회전을

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
90,268	2,613,769,710	71,640	1,983,249,775	109.96	441.04

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율.

### ▶ 중개회사별 거래내역

#### ■ 주식

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

구분	2009-07-20 ~ 2009-08-19			2009-08-20 ~ 2009-09-19			2009-09-20 ~ 2009-10-19		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	455 (67.08)	0.45 (67.10)	0.10	1,726 (77.50)	1.73 (77.51)	0.10	1,084 (64.10)	1.08 (62.28)	0.10

#### ■ 그 밖의 증권

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

구분	2009-07-20 ~ 2009-08-19			2009-08-20 ~ 2009-09-19			2009-09-20 ~ 2009-10-19		
	거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료		거래금액(비중)	수수료	
		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율		금액(비중)	수수료율
	0 (0.00)	0.00 (0.00)	0.00	181 (100.00)	0.18 (100.00)	0.10	0 (0.00)	0.00 (0.00)	0.00

#### ■ 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	
한국전력	090910	1,270	1. 상임이사 선임의 건	1,270	0	0	

※ 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>