

# 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(2009-10-20 ~ 2010-01-19)	존속기간	추가형
집합투자업자	마이다스에셋자산운용		
신탁업자	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
투자매매·중개업자	하나대투증권 한양증권 대우은행 대우증권 NH투자증권 키움닷컴증권		
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, %)

SRI ( )	전기말	당기말	증감률
(A)	2,382,394,123	3,288,396,078	38.03
(B)	44,971,341	214,610,072	377.22
(C=A-B)	2,337,422,782	3,073,786,006	31.50
(D)	1,822,685,668	2,172,840,134	19.21
가 (E=C/D*1000)	1,282.41	1,414.64	10.31

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI A1( )	전기말	당기말	증감률
(A)	253,097,174	459,083,967	81.39
(B)	631,769	1,294,554	104.91
(C=A-B)	252,465,405	457,789,413	81.33
(D)	198,421,738	327,397,638	65.00
가 (E=C/D*1000)	1,272.37	1,398.27	9.89

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI C1( )	전기말	당기말	증감률
(A)	2,073,929,839	2,613,913,847	26.04
(B)	11,403,309	47,914,403	320.18
(C=A-B)	2,062,526,530	2,565,999,444	24.41
(D)	1,626,075,383	1,843,546,379	13.37
가 (E=C/D*1000)	1,268.41	1,391.88	9.73

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI Ce( )	전기말	당기말	증감률
-----------	-----	-----	-----

(A)	12,263,608	36,319,350	196.16
(B)	37,261	70,017	87.91
(C=A-B)	12,226,347	36,249,333	196.49
(D)	9,628,346	26,000,973	170.05
가 (E=C/D*1000)	1,269.83	1,394.15	9.79

) 가 가 ( ), ( ) 가 ( ) 가

## 2. 운용경과 및 수익률현황

### ▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 9.89%이며(Class A1기준) 종합주가지수는 3.71% 상승하여 종합주가지수 대비 6.18% 초과수익을 얻었습니다. 동 기간 업종별로는 정유, 철강, 화학, 건설, 해운, 자동차, 보험, IT업종의 편입비중을 높였고 기계, 조선, 은행, 통신업종의 편입비중을 낮추었습니다. 비교지수 대비 높은 수익률을 기록한 이유는 양호한 수익률을 기록했던 철강, 화학, 해운, IT업종의 주식편입 비중이 높았기 때문이었습니다. 종목별로는 현대제철, 한진해운, 삼성물산, LG디스플레이, 하이닉스, KT, 한국전력 등이 펀드 수익률에 긍정적인 영향을 미쳤으며 SK에너지, 현대백화점, 삼성화재 등이 펀드 수익률에 부정적 영향을 주었습니다. 편입종목의 변경 내용은 대림산업, 남해화학, 신세계, 성광벤드, 두산중공업 등을 포트폴리오에 신규 편입하였으며 현대중공업, CJ오쇼핑, 종근당, 휴맥스 등을 수익률 달성 및 기업이익 추정치의 부정적 변화 등을 이유로 포트폴리오에서 제외하였습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용계획

국내경제는 경기선행지수 하락전환이라는 모멘텀 약화 국면을 맞이하고 있습니다. 글로벌 경기도 성장을 주도하는 중국의 PMI 지수가 하락전환 하였으며 OECD 경기선행지수의 하락전환이 예상되고 있습니다. 이러한 모멘텀 둔화와 일부 국가들의 재정악화 부담, 미국의 금융권 규제정책과 글로벌 출구전략 우려가 부각되며 2009년 초부터 상승 랠리를 보여온 증시는 조정국면으로 전환될 것으로 전망됩니다. 이번 분기 시장의 상승을 제한할 것으로 보이는 부정적 이슈에도 불구하고 국내증시의 상대적 가격 매력은 매우 높은 편이며 주요기업들의 글로벌 경쟁력 강화와 성장성 또한 양호한 상황입니다. 당분간은 업종중립적이고 방어적인 포트폴리오를 유지할 계획이지만 돋보이는 성장성이 예상되는 중국 소비관련 종목군, 주가대비 저평가되고 금리인상 사이클의 수혜가 예상되는 금융업종 내 종목군, 주요산업으로 성장 가능성이 높은 원자력발전 및 산업의 활성화가 예상되는 무선인터넷 관련 종목군 등에 대한 발굴에 주력하여 조정 국면 이후에 대비한 투자종목 선정에 주력할 계획입니다.

### ▶ 기간수익률

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	7.09	10.31	28.48	41.46	
비교지수	3.84	3.71	18.76	28.68	

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	6.97	9.89	27.49	39.83	
비교지수	3.84	3.71	18.76	28.68	

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	6.92	9.73	27.11	39.19	
비교지수	3.84	3.71	18.76	28.68	

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁C0(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	6.93	9.79	27.25	39.41	
비교지수	3.84	3.71	18.76	28.68	

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 증권투자신탁C(주식)

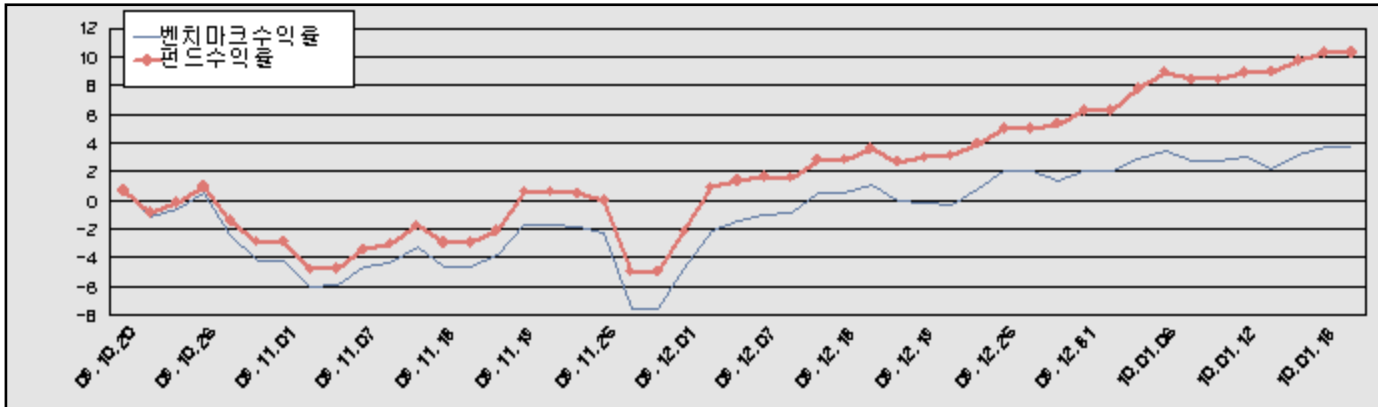
(단위 : %)

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%

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

▶ 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	254	0	0	0	0	0	0	0	0	1	23	278
전기손익	237	0	0	-0	0	0	0	0	0	0	0	237

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

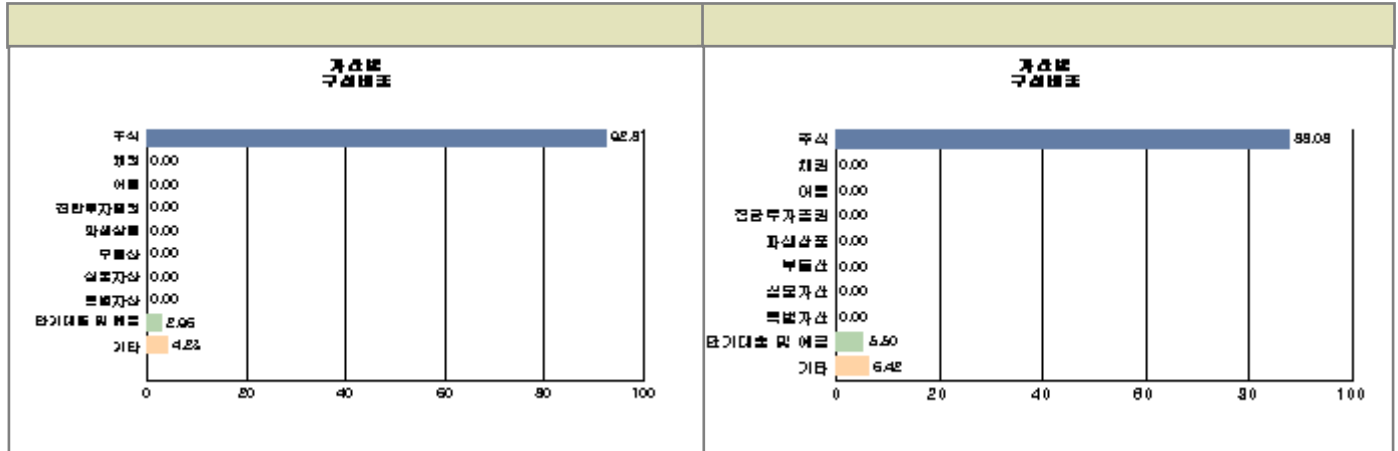
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	집합투자증권	장내	장외		실물자산	기타			

원화	2,897 (88.08)	0	0	0	0	0	0	0	0	0	181 (5.50)	211 (6.42)	3,288 (100.00)
합계	2,897 (88.08)	0	0	0	0	0	0	0	0	0	181 (5.50)	211 (6.42)	3,288 (100.00)

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



※ 위 자산구성 그래프는 클래스운용펀드 기준의 구성현황입니다.

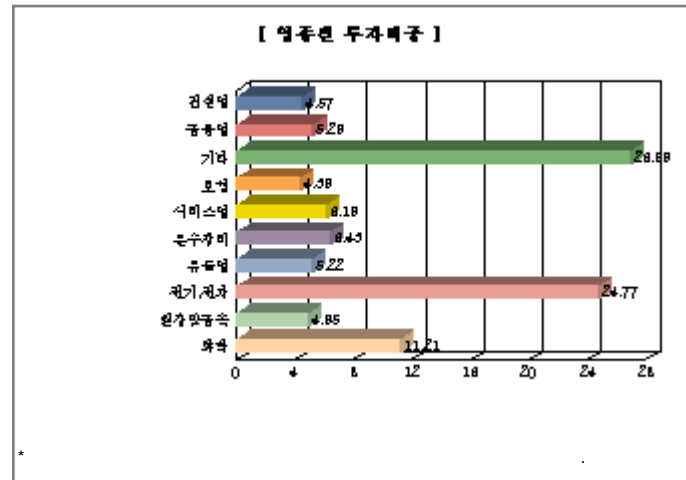
▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식) 주식투자 상위 10종목

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
삼성전자	15.03	POSCO	3.86
한국전력	3.84	하이닉스	3.61
SK에너지	3.58	대림산업	3.31
삼성물산	3.18	LG디스플레이	3.05
현대차	2.93	삼성화재	2.65

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식) 업종별 투자비중

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
전기, 전자	24.77	화학	11.21
운수장비	6.43	서비스업	6.19
금융업	5.29	유통업	5.22
철강및금속	4.95	건설업	4.57
보험	4.39	기타	26.99



▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	주식	삼성전자	13.24	2	단기대출및예금	예금	5.50
3	주식	POSCO	3.40	4	주식	한국전력	3.39
5	주식	하이닉스	3.18	6	주식	SK에너지	3.16
7	주식	대림산업	2.91	8	주식	삼성물산	2.80
9	주식	LG디스플레이	2.69	10	주식	현대차	2.58

\* ( <http://dis.kofia.or.kr> )

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	529	435,367,000	15.03
POSCO	185	111,740,000	3.86
한국전력	2,780	111,339,000	3.84
하이닉스	4,080	104,448,000	3.61
SK에너지	876	103,806,000	3.58

\* 비중 : 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

■ 상위 5개 종목

(단위 : 원, %)

종목	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
해당사항 없음							

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

▶ 어음

■ 상위 5개 종목

(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

■ 상위 5개 종목

(단위 : 원, %)

종목	종류	집합투자업자	설정원본	순자산금액	취득일	비중
해당사항 없음						

▶ 장내파생상품

(단위 : 계약, 원)

종목명	매수/매도	계약수	미결제약정금액	위탁증거금
해당사항 없음				

) 가 5%

▶ 장외파생상품

(단위 : 원)

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

) 가 5%

▶ 부동산(임대)

(단위 : 원)

종류	소재지		취득가격	보증금	비고
	등기번호	취득일	평가금액	임대수입	
해당사항 없음					

) 가 5%

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

(단위 : 원,%)

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

) 가 5%

▶ 특별자산

(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		180,897,330	1.61		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
유가증권매도미수금	185,495,548	

) 가 5%

## 4. 투자운용전문인력 현황

▶ 운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위	운용중인 다른 집합투자기구 현황		주요 경력 및 운용내역(최근5년)	협회등록번호
			기구 수	운용 규모		

허필석	2009-04-20	대표이사 1967년	12	1,176,748	서울대학교 대학원 경영학 석사 KAIST Techno MBA, CFA 장기신용은행 금융공학팀 삼성증권 자금부 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 주요운용펀드: 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	운용역 1976년	12	1,176,748	성균관대학교 경제학과 대우증권 유리자산운용 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 과장	08-02002-0043

가 : (3) (109,160)

## 5. 비용현황

### ▶ 보수 및 비용 지급현황

#### 마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	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	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	5	0.27	8	0.30	

#### 마이다스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	0	0.16	1	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.23	1	0.23	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
보수 합계	1	0.40	1	0.40	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	0	0.00	

#### 마이다스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	3	0.16	4	0.16	
투자매매/중개업자	7	0.39	9	0.39	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
보수 합계	10	0.56	13	0.56	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	0	0.00	

#### 마이다스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	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	0.01	0	0.01	
보수 합계	0	0.50	0	0.50	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	0	0.00	

\* 집합투자기구의 순자산총액 대비 비율

\*\* 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적/반복적으로 지출된 비용으로서 매매/중개수수료는 제외한 것입니다.

### ▶ 총보수비용 비율

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	1.08	0.00	1.08
당기	0.00	1.18	0.00	1.18

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.60	0.00	1.60	1.13
당기	1.60	0.00	1.60	1.24

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.24	0.00	2.24	1.08
당기	2.24	0.00	2.24	1.17

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁C0(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.00	0.00	2.00	1.10
당기	2.00	0.00	2.00	1.29

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

주2) 매매/중개수수료 비율이란 매매/중개수수료를 순자산 연평균액(보수,비용 차감전 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매/중개수수료의 수준을 나타냅니다.

## 6. 투자자산매매내역

### ▶ 매매주식규모 및 회전을

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
111,818	2,741,137,830	105,523	2,371,709,590	96.81	388.30

\* 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주가가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율.

## 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.midassasset.co.kr> / 02-3787-3500  
 금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>