

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(2010-01-20 ~ 2010-04-19)	존속기간	추가형
집합투자업자	마이다스에셋자산운용		
신탁업자	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
투자매매·중개업자	하나대투증권 한양증권 대구은행 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)	3,288,396,078	7,009,687,712	113.16
(B)	214,610,072	1,851,436,570	762.70
(C=A-B)	3,073,786,006	5,158,251,142	67.81
(D)	2,172,840,134	3,669,707,373	68.89
가 (E=C/D*1000)	1,414.64	1,405.63	-0.64

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI A1()	전기말	당기말	증감률
(A)	459,083,967	568,561,177	23.85
(B)	1,294,554	1,966,189	51.88
(C=A-B)	457,789,413	566,594,988	23.77
(D)	327,397,638	409,381,772	25.04
가 (E=C/D*1000)	1,398.27	1,384.03	-1.02

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI C1()	전기말	당기말	증감률
(A)	2,613,913,847	4,541,346,875	73.74
(B)	47,914,403	13,754,610	-71.29
(C=A-B)	2,565,999,444	4,527,592,265	76.45
(D)	1,843,546,379	3,291,205,082	78.53
가 (E=C/D*1000)	1,391.88	1,375.66	-1.17

(단위 : 원, 좌/주, %)

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

(A)	36,319,350	48,343,090	33.11
(B)	70,017	199,135	184.41
(C=A-B)	36,249,333	48,143,955	32.81
(D)	26,000,973	34,921,677	34.31
가 (E=C/D*1000)	1,394.15	1,378.63	-1.11

) 가 가 (), () 가 () 가

※ 분배금내역

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 지급일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2010-04-19	0	3,669,707,373	1,405.63	1,405.63	그린SRI증권(주식)
2010-04-19	157	409,381,772	1,384.03	1,000.00	그린SRI증권A1(주식)
2010-04-19	13	34,921,677	1,378.63	1,000.00	그린SRI증권Ce(주식)
2010-04-19	1,236	3,291,205,082	1,375.66	1,000.00	그린SRI증권C1(주식)

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 -1.02%이며(A1기준) 종합주가지수는 -0.29%를 기록하여 펀드수익률은 종합주가지수 대비 0.73% 하회하였습니다. 동 기간 동안 업종별로는 정유, 화학, 건설, 기계, 항공, 해운, 자동차, 제약, 보험, IT, 통신업종의 편입비중을 높였고 조선, 백화점, 은행, 증권, 유틸리티업종의 편입비중을 낮추었습니다. 종합주가지수 대비 낮은 수익률을 기록한 이유는 펀드내 편입비중을 높게 유지했던 건설, 제약, 보험, 통신업종의 수익률이 부진하였으며 비교적 편입비중이 낮았던 조선업종의 수익률이 종합주가지수대비 양호했기 때문이었습니다. 종목별로는 LG화학, 락앤락, 두산인프라코, 글로벌비스, 기아차, 현대모비스, LG디스플레이, 삼성전기 등이 펀드 수익률에 긍정적인 영향을 미쳤으며 포스코, LG하우시스, 대림산업, LG생명과학, 한국전력 등이 펀드 수익률에 부정적 영향을 주었습니다. 편입종목의 변경 내용은 SK텔레콤, S-OIL, 현대건설, 현대중공업, LG상사 등을 포트폴리오에 신규 편입하였으며 남해화학, 현대푸드, 웅진코웨이, GS건설, GS 등을 수익률 달성 및 기업이익 추정치의 부정적 변화 등을 이유로 포트폴리오에서 제외하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

국내 경기선행지수 하락전환이라는 모멘텀 약화 국면에도 불구하고 저금리를 기반으로 한 풍부한 글로벌 유동성의 위험자산 선호현상 및 기간 내 사상최대 규모의 외국인 순매수에 힘입어 국내증시는 해당분기 초의 단기급락을 빠른 시간에 회복하였습니다. 향후 국내증시는 사상최대 규모의 기업이익과 선진국 경제지표 호조 지속, 종합주가지수 대비 저평가된 점등에 힘입어 중장기적 상승흐름을 지속하겠지만 단기적으로는 1분기 실적 기대감의 반영과 다소 느려진 외국인의 순매수, 일부 과열의 모습을 보이는 주도종목들로 인해 변동성 확대 흐름이 전망됩니다. 단기적으로는 목표주가에 근접하거나 기술적으로 과열양상을 보이는 종목군 들을 빠르게 교체 매매하여 변동성 확대 흐름에 대비할 계획이며 하반기 주식시장을 주도할 것으로 보이는 IT업종 내 신규제품 및 부품과 관련한 종목군, 브랜드 파워 강화와 글로벌 경쟁업체 대비 저평가된 자동차업종 내 종목군, 중국 소비성장관련 종목군, 경기회복 및 원화강세의 수혜를 받는 운송업종 내 종목군 등에 대한 발굴에 주력하여 하반기 시장을 준비할 계획입니다.

▶ 기간수익률

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	1.00	-0.64	9.61	27.67	40.56
비교지수	1.14	-0.29	3.41	18.42	28.31

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	0.87	-1.02	8.78	26.19	38.40
비교지수	1.14	-0.29	3.41	18.42	28.31

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	0.82	-1.17	8.46	25.63	37.57
비교지수	1.14	-0.29	3.41	18.42	28.31

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	0.83	-1.11	8.57	25.83	37.86
비교지수	1.14	-0.29	3.41	18.42	28.31

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
집합투자지구	40.56			
비교지수	28.31			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자지구	38.40			
비교지수	28.31			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자지구	37.57			
비교지수	28.31			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

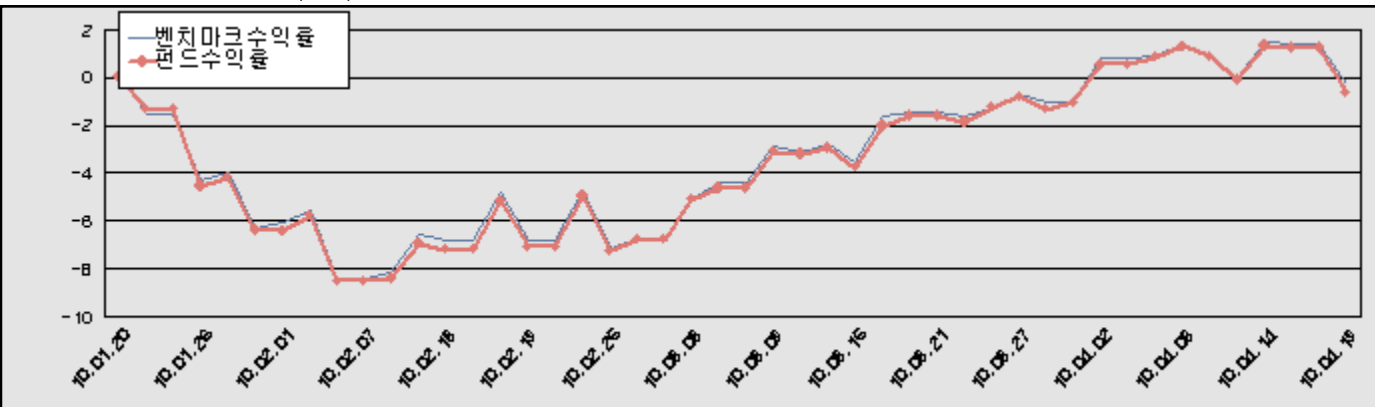
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자지구	37.86			
비교지수	28.31			

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	-60	0	0	0	0	0	0	0	0	1	-3	-62
전기손익	254	0	0	0	0	0	0	0	0	1	23	278

3. 자산현황

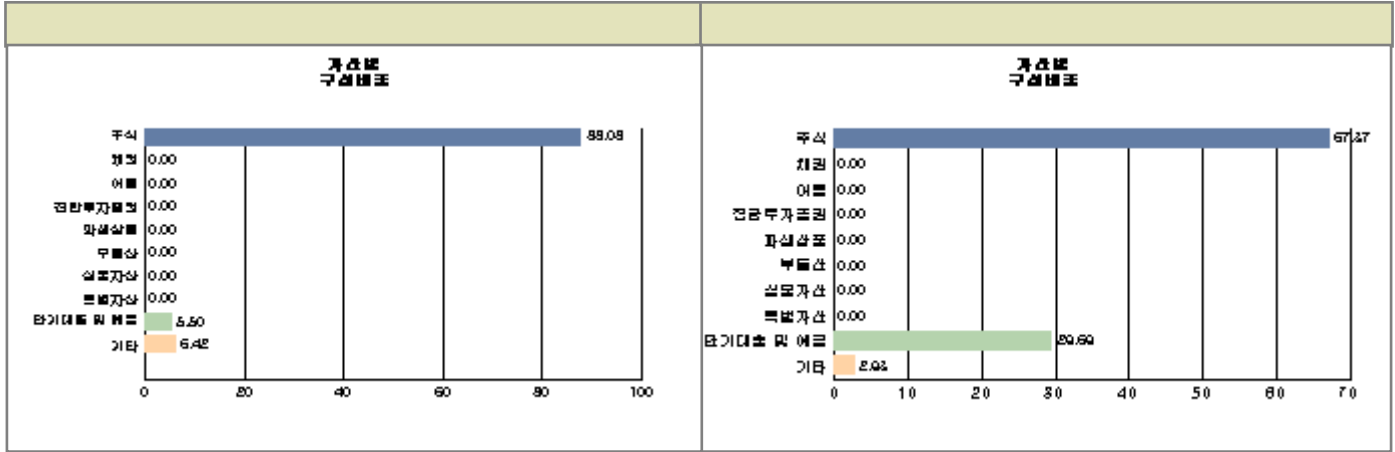
▶ 자산구성현황

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음 및 기타증권	집합투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
원화	4,723 (67.37)	0	0	0	0	0	0	0	0	2,081 (29.69)	206 (2.93)	7,010 (100.00)
합계	4,723 (67.37)	0	0	0	0	0	0	0	0	2,081 (29.69)	206 (2.93)	7,010 (100.00)

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



주) 위의 자산구성현황은 클래스운용펀드 기준의 구성현황입니다.

▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

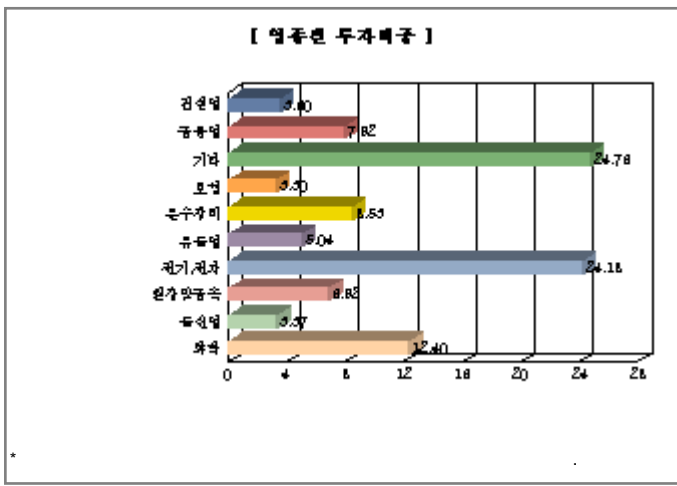
주식투자 상위 10종목

종목	비중 (%)	종목	비중 (%)
삼성전자	15.23	POSCO	6.91
락앤락	3.47	현대차	3.32
하이닉스	2.69	현대모비스	2.50
LG화학	2.42	KB금융	2.18
삼성SDI	1.99	한국전력	1.96

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

업종별 투자비중

종목	비중 (%)	종목	비중 (%)
전기, 전자	24.15	화학	12.38
운수장비	8.52	금융업	7.91
철강및금속	6.91	유통업	5.03
건설업	3.60	통신업	3.36
보험	3.29	기타	24.84



▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중	
1	단기대출및예금	25.41	2	주식	삼성전자	10.26
3	주식	4.66	4	단기대출및예금	콜 1일물 2.10	4.28
5	주식	2.33	6	주식	현대차	2.24
7	주식	1.81	8	주식	현대모비스	1.69
9	주식	1.63	10	주식	KB금융	1.47

(<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	870	719,490,000	15.23
POSCO	617	326,393,000	6.91
락앤락	6,721	163,656,350	3.47
현대차	1,319	156,961,000	3.32
하이닉스	4,765	126,987,250	2.69

※ 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
콜 1일물 2.10	동부증권	2010-04-19	300,017,260	2.10	2010-04-20	
예금	한국씨티은행		1,781,271,362	1.61		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

(단위 : 원,%)

종류	평가금액	비고
해당사항 없음		

) 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	1,171,323	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	과장 1976년	12	1,171,323	성균관대학교 경제학과 대우증권 유리자산운용 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 과장	08-02002-0043

) 가 : (7) (74,456) (: ,)

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	2	0.05	
매매/중개수수료	8	0.30	13	0.40	

마이다스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	1	0.16	1	0.16	
투자매매/중개업자	1	0.23	1	0.22	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	1	0.40	2	0.40	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	0	0.00	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	4	0.16	4	0.16	
투자매매/중개업자	9	0.39	10	0.38	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	13	0.56	14	0.56	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	0	0.00	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C6(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	0	0.16	0	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.33	0	0.32	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	0	0.50	0	0.49	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	0	0.00	

* 집합투자자구의 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 집합투자자구		상위펀드 비용 합산	
	총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율	합성 총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율
전기	0.00	1.18	0.00	1.18
당기	0.20	1.62	0.20	1.62

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자자구		상위펀드 비용 합산	
	총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율	합성 총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율
전기	1.60	0.00	1.60	1.24
당기	1.61	0.00	1.74	1.54

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자자구		상위펀드 비용 합산	
	총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율	합성 총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율
전기	2.24	0.00	2.24	1.17
당기	2.25	0.00	2.47	1.65

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C6(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자자구		상위펀드 비용 합산	
	총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율	합성 총보수, 비용비율	매매, 중개수수료 비율
전기	2.00	0.00	2.00	1.29
당기	2.01	0.00	2.15	1.55

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

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

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전율

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
108,082	3,949,002,950	74,662	2,104,098,740	69.14	283.56

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