

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(2010-04-20 ~ 2010-07-19)	존속기간	추가형
집합투자업자	마이다스에셋자산운용		
신탁업자	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
투자매매·중개업자	하나대투증권 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)	7,009,687,712	4,429,486,056	-36.81
(B)	1,851,436,570	47,929,610	-97.41
(C=A-B)	5,158,251,142	4,381,556,446	-15.06
(D)	3,669,707,373	2,880,594,539	-21.50
가 (E=C/D*1000)	1,405.63	1,521.06	8.21

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI A1()	전기말	당기말	증감률
(A)	568,561,177	796,287,575	40.05
(B)	1,966,189	14,179,994	621.19
(C=A-B)	566,594,988	782,107,581	38.04
(D)	409,381,772	725,530,244	77.23
가 (E=C/D*1000)	1,384.03	1,077.98	7.80

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI C1()	전기말	당기말	증감률
(A)	4,541,346,875	3,112,914,483	-31.45
(B)	13,754,610	15,227,826	10.71
(C=A-B)	4,527,592,265	3,097,686,657	-31.58
(D)	3,291,205,082	2,877,697,496	-12.56
가 (E=C/D*1000)	1,375.66	1,076.45	7.65

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI C2()	전기말	당기말	증감률
-----------	-----	-----	-----

(A)	-	412,386,975	-
(B)	-	936,263	-
(C=A-B)	-	411,450,712	-
(D)	-	385,618,069	-
가 (E=C/D*1000)	-	1,066.99	-

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI	Ce()	전기말	당기말	증감률
(A)		48,343,090	71,704,602	48.32
(B)		199,135	262,354	31.75
(C=A-B)		48,143,955	71,442,248	48.39
(D)		34,921,677	66,323,079	89.92
가 (E=C/D*1000)		1,378.63	1,077.19	7.72

) 가 가 (), () 가 () 가

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 7.80%이며 종합주가지수는 1.56% 상승하여 펀드수익률은 비교지수 대비 6.24% 상회하였습니다. (Class A기준) 동 기간 동안 업종별로는 정유, 화학, 기계, 항공, 해운, 자동차, 음식료, 보험, 증권, IT업종의 편입비중을 높였고 철강, 조선, 유통, 제약, 은행, 통신, 유틸리티업종의 편입비중을 낮추었습니다. 비교지수 대비 높은 수익률을 기록한 이유는 비교적 높은 비중을 차지했던 화학, 기계, 항공, 해운, 음식료, 증권업종의 수익률이 양호하였으며 낮은 비중을 유지했던 철강, 제약, 은행, 유틸리티업종의 수익률이 비교지수 대비 부진했기 때문이었습니다. 종목별로는 LG화학, 락앤락, 한전기술, 대한항공, 한진해운, CJ제일제당, 우리투자증권, 삼성SDI, 삼성전기 등이 펀드 수익률에 긍정적인 영향을 미쳤으며 LG하우시스, KB금융, 삼성화재, 하이닉스 등이 펀드 수익률에 부정적 영향을 주었습니다. 편입종목의 변경 내용은 LS, 고려아연, NHN, 엔씨소프트, 효성 등을 포트폴리오에 신규 편입하였으며 대림산업, SK텔레콤, 신세계, KT, 두산중공업 등을 수익률 달성 및 기업이익 추정치의 부정적 변화 등을 이유로 포트폴리오에서 제외하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

조심스러운 시각 속에서 하반기 주식시장에 대한 긍정적 관점을 유지하고 있습니다. 유로존의 국가채무 리스크는 상당기간 지속될 것으로 보고 있으며 부동산을 중심으로 인축이 진행 중인 중국과 경제선행지수의 하강국면에서 실망스런 결과를 보이는 미국의 경제지표들이 부정적인 영향을 미치지 않아 아직까지 통제 가능한 인플레이션 리스크와 저금리를 바탕으로 시중 유동성 및 연기금의 매수여력이 긍정적입니다. 유로존 약재의 해소가 좀더 분명해 질 때까지 주식시장은 불안정한 모습을 보이며 기간조정을 겪을 것으로 예상하지만 유로존의 약재와 중국의 인축에 대해서 일정부분 기간적인 반영을 거친 후에는 국내 주요산업의 상대 경쟁력과 매력적인 Valuation을 바탕으로 점진적 상승세로 전환할 것으로 전망합니다. 비철금속, 화학, 건설, 기계, 운수장비, 증권, 보험, IT업종의 펀드내 편입비중을 비교적 높게 유지할 계획이며 소재, 산업재 섹터내의 성장 모멘텀을 보유한 종목에 대한 선별적인 선호와 글로벌 경쟁력을 바탕으로 구조적인 경쟁력 강화가 진행중인 대표종목에 대한 비중 상황 예정입니다. 또한 수요인 및 금리전망에 따라 저평가된 보험업종을 선호하며 기업실적 대비 저평가 매력을 보유한 건설, 기계업종과 하반기 주식시장 상승에 대비해 증권업종에 대한 선취매가 필요하다고 판단합니다. 단기적으로는 변동성 확대를 주의해야 하지만 현재 지수 대에서는 하반기 전략종목과 업종에 대한 적극적인 발굴과 편입에 주력할 계획입니다. 신재생에너지, 중국소비성장 수혜, 거시경제 불확실성에 영향을 덜 받는 업종(인터넷, 게임, 원전 등), 업황 턴어라운드 예상업종(플랜트 부품, 엔진, 증권)에 대한 투자를 확대할 예정입니다.

▶ 기간수익률

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	1.44	8.21	7.52	18.61	38.15
비교지수	1.17	1.56	1.27	5.03	20.27

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	1.31	7.80	6.70	17.26	36.04
비교지수	1.17	1.56	1.27	5.03	20.27

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	1.27	7.65	6.39	16.75	35.23
비교지수	1.17	1.56	1.27	5.03	20.27

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	1.27				
비교지수					

비교지수(Bench Mark) = 없음

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자지구	1.29	7.72	6.52	16.95	35.54
비교지수	1.17	1.56	1.27	5.03	20.27

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	38.15			
비교지수	20.27			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자지구	36.04			
비교지수	20.27			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자지구	35.23			
비교지수	20.27			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : %)

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

주) 상위 펀드는 설정일 1년 미만의 펀드로 연평균수익률을 표시하지 않습니다.

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

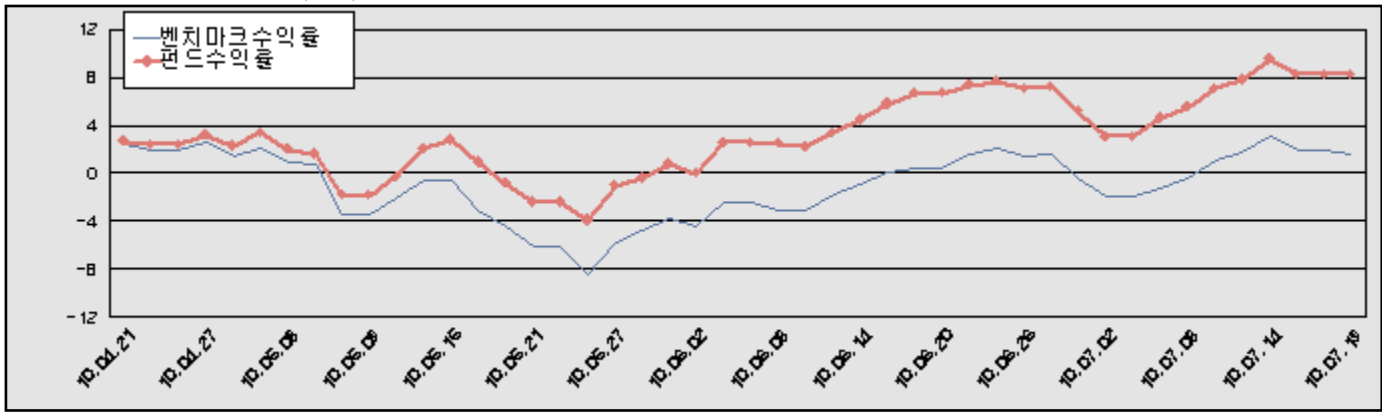
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자지구	35.54			
비교지수	20.27			

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	341	0	0	0	0	0	0	0	0	1	-12	330
전기손익	-60	0	0	0	0	0	0	0	0	1	-3	-62

3. 자산현황

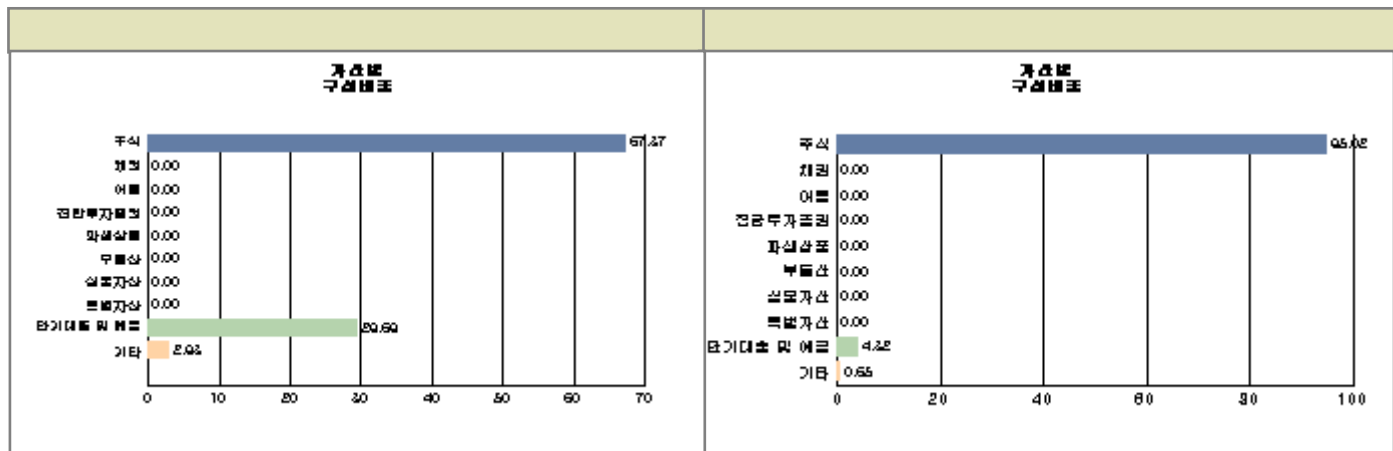
▶ 자산구성현황

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	4,209 (95.02)	0	0	0	0	0	0	0	0	192 (4.32)	29 (0.65)	4,429 (100.00)
합계	4,209 (95.02)	0	0	0	0	0	0	0	0	192 (4.32)	29 (0.65)	4,429 (100.00)

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



주) 위 자산구성 그래프는 클래스운용펀드 기준의 구성현황입니다.

▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

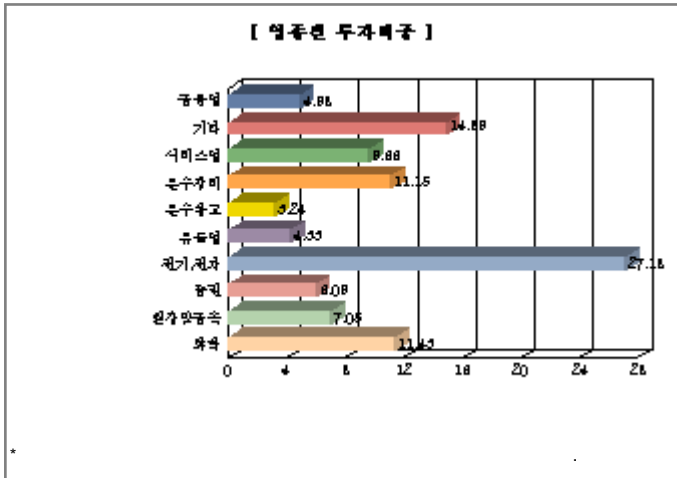
주식투자 상위 10종목

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
삼성전자	13.33	현대차	6.05
우리투자증권	4.43	POSCO	2.98
하이닉스	2.82	LG디스플레이	2.78
현대모비스	2.67	LG화학	2.59
LS	2.44	고려아연	2.40

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

업종별 투자비중

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
전기, 전자	27.18	화학	11.43
운수장비	11.15	서비스업	9.66
철강및금속	7.05	증권	6.09
금융업	4.98	유통업	4.33
운수창고	3.23	기타	14.90



▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	12.67	2	주식	현대차	5.74
3	단기대출및예금	예금	4.32	4	주식	우리투자증권	4.21
5	주식	POSCO	2.83	6	주식	하이닉스	2.68
7	주식	LG디스플레이	2.65	8	주식	현대모비스	2.54
9	주식	LG화학	2.46	10	주식	LS	2.32

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

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

종목	보유수량	평가금액	비중
----	------	------	----

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	706	561,270,000	13.33
현대차	1,899	254,466,000	6.05
우리투자증권	9,767	186,549,700	4.43
POSCO	255	125,332,500	2.98
하이닉스	5,010	118,737,000	2.82

※ 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)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	한국씨티은행		191,554,246	1.84		

※ 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	11	1,097,203	서울대학교 대학원 경영학 석사 KAIST Techno MBA, CFA 장기신용은행 금융공학팀 삼성증권 자금부 現 마이더스에셋자산운용 대표이사 주요운용펀드 : 마이더스복원채배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	과장 1976년	11	1,097,203	성균관대학교 경제학과 대우증권 유리자산운용 現 마이더스에셋자산운용 주식운용본부 과장	08-02002-0043

) 가 : (5) (63,620) (: ,)

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

마이더스 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**	2	0.05	0	0.00	
매매/중개수수료	13	0.40	21	0.48	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	1	0.16	1	0.16	
투자매매/중개업자	1	0.22	1	0.22	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	2	0.40	3	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	6	0.16	
투자매매/중개업자	10	0.38	13	0.38	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	14	0.56	19	0.55	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	0	0.00	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	0	0.00	0	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.00	1	0.33	
신탁업자	0	0.00	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	0	0.00	1	0.51	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	0	0.00	0	0.00	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	0	0.00	0	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.00	0	0.30	
신탁업자	0	0.00	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	0	0.00	0	0.48	
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 집합투자지구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.20	1.62	0.20	1.62
당기	0.01	1.92	0.01	1.92

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자지구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.61	0.00	1.74	1.54
당기	1.60	0.00	1.61	1.86

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자지구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.25	0.00	2.47	1.65
당기	2.21	0.00	2.22	1.97

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자지구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	0.00	0.00	0.00
당기	2.03	0.00	2.03	1.36

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자지구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	0.00	0.00	0.00
당기	1.91	0.00	1.92	1.85

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

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
140,512	3,993,302,805	155,741	4,960,653,510	118.18	479.30

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 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 집합투자지구의 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>