마이다스에셋자산운용 월간자산운용보고서

(준법감시인심사필2010-383호)

마이다스 그린SRI 증권 투자신탁(주식)

2010년 09월

Fund Facts

투자 목적	이 투자신탁은 주식형펀드로서 자산의 대부분을 주식에 투자하며, 주식 투자시 재무적 기업평가 방식과 비재무적 기업평가 방식(그린산업/SRI)을 함께 활용하여 투자대상 종목을 선정•투자하여 종합주가지수 이상의 수익을 얻는 것을 주목적으로 합니다.
운용개시일	2009-04-20
펀드 규모	54 억원
총보수	A1- 1%선취 + 연1.60%/C1-연2.20%
환매수수료	A1-30일미만 이익금의 70% 30일~90일, 이익금의 30% C1-90일미만 이익금의 70%

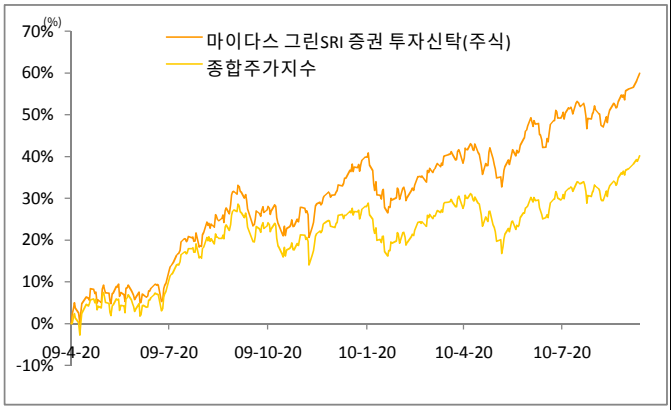
펀드운용실적

구분	1개월	3개월	6개월	1년	설정이후
그린SRI 증권 투자신탁	7.94%	10.19%	15.94%	23.43%	59.90%
종합주가지수	7.46%	10.28%	10.63%	11.93%	40.92%
초과수익률	0.48%	-0.08%	5.31%	11.50%	18.98%

※펀드 기준가 및 수익률은 Class A1 기준임.

수익률 추이

(2009.04.17~2010.09.30)



펀드매니저 리포트

이 펀드는 운용개시일 이후부터의 수익률은 59.90%를 기록하고 있으며, 동 기간 종합주가지수 변동률은 40.92%를 기록하여 종합주가지수 대비 18.98% 높은 수익률을 기록하고 있습니다. 지난 9월 한 달간 펀드 수익률은 7.94%였으며 동 기간 종합주가지수는 7.46% 상승하여 종합주가지수 대비 0.48% 높은 수익률을 기록하였습니다. 종합주가지수 대비 높은 수익률을 기록한 이유는 다음과 같습니다. 9월 주식시장은 기계, 운수장비, 유통, 운수창고, 증권업종 등이 종합주가지수대비 초과수익을 기록했고 화학, 의약, IT, 전기가스, 통신, 보험업종 등이 종합주가지수 대비 하회하는 수익을 기록하였는데 펀드 내 업종전략에 있어서 기계, 운수창고, 증권업종의 편입비중이 높았고, 화학, 통신, 보험업종의 편입비가 낮았기 때문입니다.

주식 시황 및 자산배분

지난 9월 한 달은 글로벌 자금들의 이동에 따라 (위험회피자산(채권, 현금 등)으로부터 위험자산(주식 등)으로, 선진국에서 이머징 국가로), 이머징시장에 속해있는 한국시장의 주식자산으로 해외자금이 집중되면서 7.5%의 큰 상승을 보였습니다. 업종별로는 기계, 운수장비, 운수창고, 유통, 증권, 건설, 철강, 은행, 서비스 등 업종이 지수대비 큰 상승을 보였고, 보험, 금융, 섬유의복, 전기가스, 전기전자, 종이목재, 통신, 의약품, 음식료, 화학업종 등이 상대적인 약세를 보인 한 달이었습니다. 현재 펀드에서 주식편입비율은 98% 내외를 유지하고 있습니다.

종목선택

주식편입비율의 80% 이상은 비재무적 평가 기준 40%(그린산업/SRI)와 재무적 평가 기준 60%를 함께 적용하여 선정한 그린SRI유니버스로 구성되며 나머지는 초과수익을 목적으로 당사 리서치를 통하여 선별한 트레이딩포트폴리오에 투자하고 있습니다.

1 그린SRI유니버스

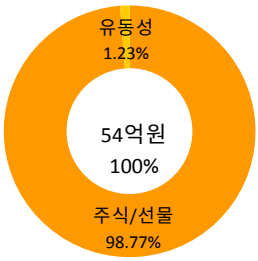
9월말 현재 그린SRI유니버스 투자비중은 주식 투자금액 중에서 약 94% 수준을 차지하고 있습니다. 종목별 수익률을 보면 그린SRI유니버스 중에서는 효성, 현대건설, 두산인프라, 우리투자증권 등의 수익률이 양호했으며 포스코, KB, LG전자, 삼성SDI 등의 수익률이 부진했습니다. 포트폴리오 주요변경 내용은 SK, 현대중공업, 세아베스틸, 웅진코웨이 등을 신규 편입하였으며 현대산업, 성광벤드, 삼성전기, 두산중공업 등을 목표주가 도달에 따른 이익실현 및 수익추정의 부정적 변화를 이유로 제외했습니다.

2. 트레이딩포트폴리오

9월말 현재 주식투자 비중에서 그린SRI유니버스 미포함 주식은 약 6% 수준을 차지하고 있습니다. 종목별 수익률을 보면 카프로, STX 등의 수익률이 양호했으며 네패스 등의 수익률이 부진했습니다. 포트폴리오 주요변경 내용은 카프로, 실리콘웍스 등을 신규편입 했으며 STX 등을 목표주가 도달에 따른 이익실현 및 수익추정의 부정적 변화를 이유로 제외했습니다.

포트폴리오 현황

[2010.09.30 기준]



상위보유종목

[2010.07.31 기준]

(순자산총액 비중 60.34%)

1. 삼성전자
2. 현대차
3. 우리투자증권
4. 하이닉스
5. 현대제철
6. POSCO
7. 현대모비스
8. LG전자
9. LG화학
10. 삼성물산
11. LS
12. SK에너지
13. 고려아연
14. 삼성화재
15. LG디스플레이
16. 엔씨소프트
17. 신한지주
18. NHN
19. 삼성테크윈
20. LG

본 상품은 예금자 보호법에 의해 보호되지 않으며 판매회사와 판매회사의 어떤 관계회사도 그 수익이나 원금을 보장하지 않으며 그러한 의무도 없습니다, 본자료에 사용된 정보들은 신뢰할 만한 자료에 바탕을 두고 있으나 정확성과 완전함이 보장되진 않으며, 본 자료상의 운용계획은 시장 상황의 변동이나 운용 전략상의 변화에 따라 달라질 수 있습니다. 과거의 실현수익률로 미래의 수익률을 예측하거나 보장할 수 없으며, 상품에 대해 보다 자세한 내용을 확인하기 위해 약관 및 투자설명서를 반드시 읽어보시기 바랍니다. 또한 본 자료는 투자권유를 위한 목적으로 사용될 수 없습니다.