

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(2010-07-20 ~ 2010-10-19)	존속기간	추가형
집합투자업자	마이다스에셋자산운용		
신탁업자	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
투자매매·중개업자	하나대투증권 대구은행 대우증권 NH투자증권 키움닷컴증권 한국외환은행 신한금융투자		
상품의 특징	본 상품은 주식형 펀드로서 약관상 주식에 60% 이상 투자하고 있으며 종합주가지수를 비교지수로 하고 있습니다. 녹색성장과 관련된 투자기회를 선점하고, 사회책임 우수기업에 장기 투자하면서, 추가대비 저평가 기업을 발굴 투자 함으로서 비교지수 대비 초과성과를 목표로 하고 있습니다. 이 펀드는 그린산업(GG: Green Growth)과 기업지배구조 및 사회공헌(GS: Governance & Social)이라는 비재무적 평가기준과 재무적 평가 방법(Midas Fundamental Index)을 병행하여 종목별 투자등급을 결정(AAA~C 9단계)합니다. 비재무적 평가와 재무적 평가는 4:6으로 적용되며 최종 투자등급 중 BBB등급 이상종목을 그린SRI Universe로 선정하여 실제 펀드의 주식 포트폴리오에는 80%이상 투자하고 나머지는 Trading Portfolio를 통해 초과수익을 추구합니다. 자산의 60% 이상을 주식에 투자하는 특성상 유가, 환율, 금리 등 다양한 거시변수와 투자된 기업의 고유위험이 수익률에 영향을 미치는 특성을 가지고 있습니다.		

- ☞ 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)	4,429,486,056	5,493,160,568	24.01
(B)	47,929,610	62,773,485	30.97
(C=A-B)	4,381,556,446	5,430,387,083	23.94
(D)	2,880,594,539	3,329,044,243	15.57
가 (E=C/D*1000)	1,521.06	1,631.22	7.24

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI A1()	전기말	당기말	증감률
(A)	796,287,575	1,173,255,540	47.34
(B)	14,179,994	7,295,433	-48.55
(C=A-B)	782,107,581	1,165,960,107	49.08
(D)	725,530,244	1,012,531,346	39.56
가 (E=C/D*1000)	1,077.98	1,151.53	6.82

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI C1()	전기말	당기말	증감률
(A)	3,112,914,483	3,209,968,563	3.12
(B)	15,227,826	16,840,881	10.59
(C=A-B)	3,097,686,657	3,193,127,682	3.08
(D)	2,877,697,496	2,780,903,886	-3.36
가 (E=C/D*1000)	1,076.45	1,148.23	6.67

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI	C2()	전기말	당기말	증감률
	(A)	412,386,975	954,937,980	131.56
	(B)	936,263	3,185,778	240.27
	(C=A-B)	411,450,712	951,752,202	131.32
	(D)	385,618,069	835,962,784	116.79
	가 (E=C/D*1000)	1,066.99	1,138.51	6.70

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI	Ce()	전기말	당기말	증감률
	(A)	71,704,602	96,483,044	34.56
	(B)	262,354	375,791	43.24
	(C=A-B)	71,442,248	96,107,253	34.52
	(D)	66,323,079	83,582,087	26.02
	가 (E=C/D*1000)	1,077.19	1,149.85	6.75

) 가 가 (), () 가 () 가

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 6.82%였으며 종합주가지수의 변동률은 7.24%를 기록하여 펀드수익률은 비교지수 대비 0.42% 낮은 수익률을 기록하였습니다. (Class A1기준) 동 기간 동안 업종별로는 철강, 자동차, 증권, IT업종의 편입비중을 높였고 화학, 조선업종의 편입비중을 낮추었지만 철강, IT업종의 부진한 성과가 펀드 수익률에 안 좋은 영향을 미쳤습니다.

-**철강, IT업종의 성과 부진**: 중국의 에너지 절감정책에서 비롯된 공급축소의 수혜가 예상되었던 철강업종과, 수요에 대한 우려로 저평가 매력이 컸던 IT업종에 대한 기대감으로 펀드 내 편입비중을 높게 유지하였지만 해당 분기 철강, IT업종이 전반적으로 부진한 성과를 기록하였습니다.

-**자동차, 증권업종의 성과 양호**: 구조적인 성장이 진행중인 자동차 업종의 수익률은 계속 양호한 상황이며 증권 업종 역시 주식시장의 중기 상승국면에 대한 수혜를 받아 양호한 성과를 기록하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

향후 경기지표개선에 대한 기대감, 글로벌 유동성 유입 지속 가능성에 대한 기대감으로 11월초까지 주식시장은 완만한 기간조정 흐름 후 상승추세로 전환 예상됩니다. 미국의 양적 완화 정책에 대한 기대감으로 추세적인 약 달러의 진행과 글로벌 유동성의 국내 주식시장으로의 유입이 지속되고 있습니다. 4분기 중국과 국내 경기선행지수의 상승반전 기대감이 높기 때문에 주식시장의 중기 상승추세와 유동성의 유입을 유지해 줄 것으로 기대합니다. 하지만 지난 분기 시장을 주도했던 일부 종목군 들의 심리와 기술적 지표들이 과열양상을 보이고 있으며 이러한 조정 신호들은 주식시장의 중기 체력비축을 위한 기간조정 가능성을 내포하고 있다고 판단합니다. 따라서, 중기 상승추세에 대비하여 상승잠재력이 큰 종목군으로 포트폴리오를 교체할 계획입니다. 또한, 소비, 고용 등 경기지표개선에 대한 기대감을 바탕으로 순수IT업종에 대한 편입비중을 확대할 계획이며(반도체, 디스플레이), 연말로 갈수록 중국, 대한민국의 순차적인 경기선행지수 상승전환에 대한 가능성을 바탕으로 철강, 은행업종에 대한 편입비중을 확대할 계획입니다. 유동성 여건과 기간 조정 흐름 속에서 개별 종목에 대한 관심이 높아 질 것으로 예상하기 때문에 저 평가 매력을 보유한 중소형 IT 종목의 발굴, 편입할 계획입니다.

▶ 기간수익률

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기금	2.49	7.24	16.05	15.31	27.20
비교지수	1.64	7.24	8.91	8.60	12.63

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기금	2.36	6.82	15.15	13.98	25.26
비교지수	1.64	7.24	8.91	8.60	12.63

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	2.31	6.67	14.82	13.48	24.53
비교지수	1.64	7.24	8.91	8.60	12.63

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	2.32	6.70			
비교지수					

비교지수(Bench Mark) = 없음

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	2.34	6.75	14.98	13.70	24.84
비교지수	1.64	7.24	8.91	8.60	12.63

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	27.20			
비교지수	12.63			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구	25.26			
비교지수	12.63			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구	24.53			
비교지수	12.63			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : %)

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

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

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C(주식)

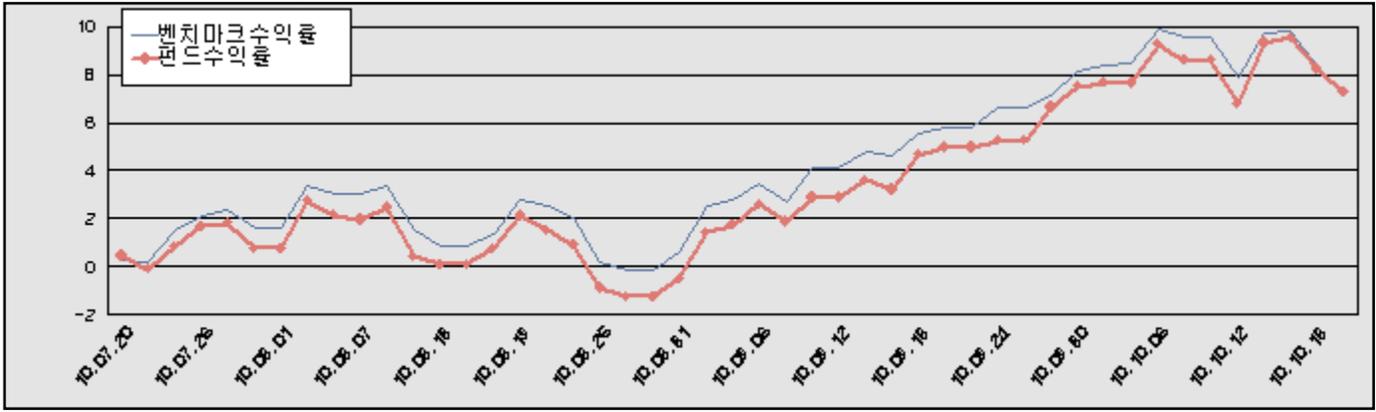
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구	24.84			
비교지수	12.63			

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	354	0	0	0	0	0	0	0	0	1	-3	352
전기손익	341	0	0	0	0	0	0	0	0	1	-12	330

3. 자산현황

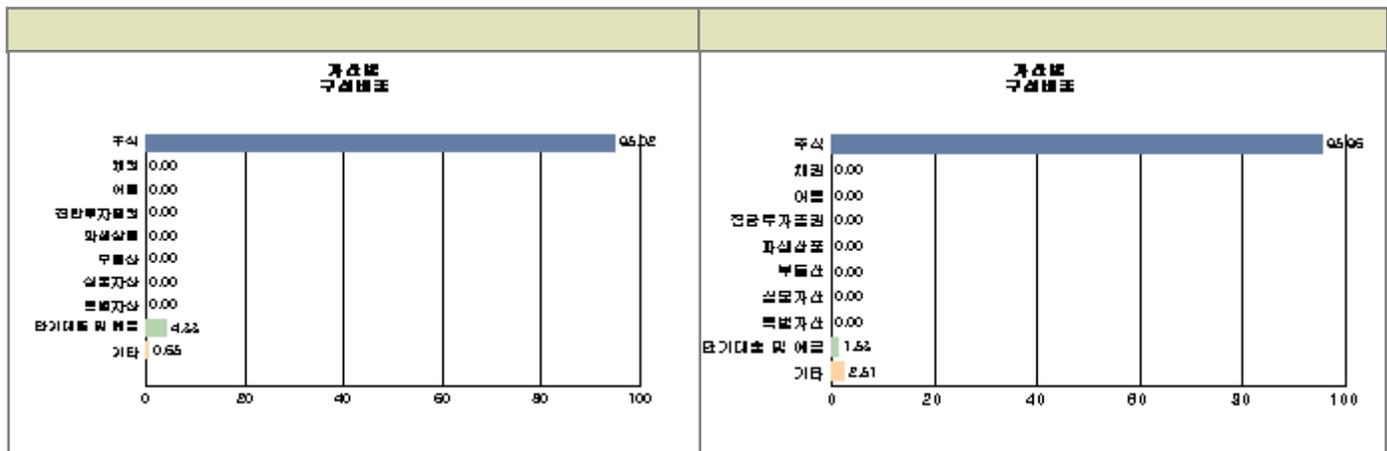
▶ 자산구성현황

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	5,271 (95.96)	0	0	0	0	0	0	0	0	84 (1.53)	138 (2.51)	5,493 (100.00)
합계	5,271 (95.96)	0	0	0	0	0	0	0	0	84 (1.53)	138 (2.51)	5,493 (100.00)

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



주) 위 자산구성 그래프는 클래스운용펀드 기준의 구성현황입니다.

▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

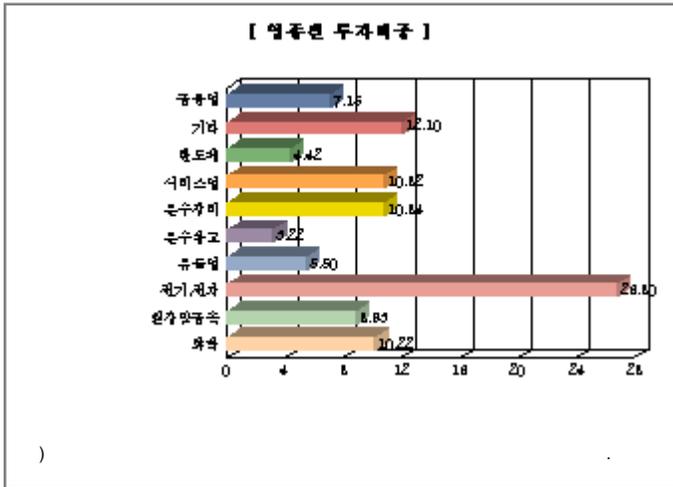
주식투자 상위 10종목

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
삼성전자	11.40	하이닉스	4.92
POSCO	4.43	네패스	3.48
LG디스플레이	3.42	현대차	3.34
삼성물산	2.87	NHN	2.35
현대모비스	2.34	우리금융	2.32

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

업종별 투자비중

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
전기, 전자	26.80	운수장비	10.84
서비스업	10.82	화학	10.22
철강및금속	8.93	금융업	7.15
유통업	5.50	반도체	4.42
운수참고	3.22	기타	12.10



▶ 투자대상 상위 10종목

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	10.94	2	주식	하이닉스	4.72
3	주식	POSCO	4.25	4	주식	네패스	3.34
5	주식	LG디스플레이	3.28	6	주식	현대차	3.20
7	주식	삼성물산	2.76	8	주식	NHN	2.25
9	주식	현대모비스	2.25	10	주식	우리금융	2.22

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

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

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

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

종목	보유수량	평가금액	비중
삼성전자	811	600,951,000	11.40
하이닉스	11,350	259,347,500	4.92
POSCO	477	233,253,000	4.43
네패스	9,392	183,613,600	3.48
LG디스플레이	4,454	180,164,300	3.42

※ 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		84,074,688	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	9	917,852	서울대학교 대학원 경영학 석사KAIST Techno MBA, CFA장기신용은행 금융공학팀삼성증권 자금부現 마이더스에셋자산운용 대표이사 ☞ 주요운용펀드 : 마이더스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	운용역 1976년	9	917,852	성균관대학교 경제학과 대우증권 유리자산운용 現 마이더스에셋자산운용 주식운용본부 과장 ☞ 주요운용펀드 : 마이더스그린SRI 증권투자신탁(주식)	08-02002-0043

)
가
:
:(1) (277,806) (: ,)

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**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	21	0.48	6	0.13	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	1	0.16	2	0.16	
투자매매/중개업자	1	0.22	2	0.23	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	3	0.40	4	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	6	0.16	5	0.16	
투자매매/중개업자	13	0.38	12	0.38	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	19	0.55	18	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	0.16	1	0.16	
투자매매/중개업자	1	0.33	2	0.34	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	1	0.51	3	0.52	
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	0.16	0	0.16	
투자매매/중개업자	0	0.30	0	0.30	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	0	0.48	0	0.48	
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 제외된 것입니다.

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.01	1.92	0.01	1.92
당기	0.02	0.50	0.02	0.50

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	1.61	1.86
당기	1.60	0.00	1.62	0.49

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.21	0.00	2.22	1.97
당기	2.20	0.00	2.22	0.51

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.03	0.00	2.03	1.36
당기	2.05	0.00	2.08	0.48

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.91	0.00	1.92	1.85
당기	1.90	0.00	1.92	0.50

- 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
136,826	3,313,003,280	123,644	2,634,722,040	54.82	219.89

※ 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 집합투자기구의 신탁업자 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이더스에셋자산운용 <http://www.midasset.co.kr> / 02-3787-3500
 금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>