

# 자 산 운 용 보 고 서

## 1. 집합투자기구의 개요

### ▶ 기본정보

「적용법률: 자본시장법(신규 설정)」

위험등급 : 1등급

집합투자기구명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)		93983	
집합투자기구의 종류	투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형	최초설정일	2009-04-20
운용기간	3개월(2010-10-20 ~ 2011-01-19)	존속기간	추가형
집합투자업자	마이더스에셋자산운용		
신탁업자	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
투자매매·중개업자	하나대투증권 대구은행 대우증권 한국외환은행 신한금융투자 NH투자증권 키움닷컴증권 비에스투자증권		
상품의 특징	본 상품은 주식형 펀드로서 약관상 주식에 60% 이상 투자하고 있으며 종합주가지수를 비교지수로 하고 있습니다. 녹색성장과 관련된 투자기회를 선점하고, 사회적임 우수기업에 장기투자하면서, 추가대비저평가 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 투자 대상 종목을 선정하여 비교지수 대비 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)	5,493,160,568	7,310,859,891	33.09
(B)	62,773,485	231,768,421	269.21
(C=A-B)	5,430,387,083	7,079,091,470	30.36
(D)	3,329,044,243	3,740,892,114	12.37
가 (E=C/D*1000)	1,631.22	1,892.35	16.01

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI A1( )	전기말	당기말	증감률
(A)	1,173,255,540	1,771,053,019	50.95
(B)	7,295,433	8,197,361	12.36
(C=A-B)	1,165,960,107	1,762,855,658	51.19
(D)	1,012,531,346	1,324,579,453	30.82
가 (E=C/D*1000)	1,151.53	1,330.88	15.57

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI C1( )	전기말	당기말	증감률
(A)	3,209,968,563	3,805,162,159	18.54
(B)	16,840,881	18,169,029	7.89
(C=A-B)	3,193,127,682	3,786,993,130	18.60
(D)	2,780,903,886	2,857,571,851	2.76
가 (E=C/D*1000)	1,148.23	1,325.25	15.42

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI	C2( )	전기말	당기말	증감률
	(A)	954,937,980	1,386,030,785	45.14
	(B)	3,185,778	10,953,539	243.83
	(C=A-B)	951,752,202	1,375,077,246	44.48
	(D)	835,962,784	1,046,135,622	25.14
	가 (E=C/D*1000)	1,138.51	1,314.43	15.45

(단위 : 원, 좌/주, %)

SRI	Ce( )	전기말	당기말	증감률
	(A)	96,483,044	124,934,120	29.49
	(B)	375,791	459,893	22.38
	(C=A-B)	96,107,253	124,474,227	29.52
	(D)	83,582,087	93,732,001	12.14
	가 (E=C/D*1000)	1,149.85	1,327.98	15.49

) 가 가 ( ), ( ) 가 ( ) 가

## 2. 운용경과 및 수익률현황

### ▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 15.57%이며 종합주가지수는 13.91% 상승하여 펀드수익률은 비교지수 대비 1.66% 상회하였습니다. (Class A1기준) 동 기간 동안 업종별로는 에너지, 화학, 건설, 조선, 은행, 보험업종의 편입비중을 높였고 철강, 항공, 음식료, 증권업종의 편입비중을 낮추었습니다.

-공격적인 자산배분전략의 양호한 성과: 연말연초라는 주식시장에 우호적인 환경 속에서 글로벌 유동성의 국내 주식시장 유입과 미국의 경기지표 개선 기대감을 바탕으로 주식시장의 중기 상승추세가 지속될 것이라고 판단하였습니다. 동 기간 동안 높은 편입비율을 유지하며 상승잠재력과 베타가 큰 종목군으로 적극적으로 포트폴리오를 교체하여 펀드 성과 제고에 기여하였습니다.

-에너지, 화학, 반도체업종의 성과 양호: 좋은 영업환경을 보이는 업종 내에서 글로벌 경쟁력을 갖춘 종목군의 비중을 상향하였습니다. 이러한 측면에서 편입 비중을 높은 호남석유, 한화케미칼, GS, 삼성전자, 하이닉스 등이 펀드 성과 제고에 기여하였습니다.

### ▶ 투자환경 및 운용계획

지난 분기 시장의 악재 중 하나로 작용하던 유로존 국가채무 위험은 대규모 만기가 도래하는 3월 이전까지는 우려가 수면아래로 내려가 있을 것으로 보입니다. 중국을 중심으로 이머징 국가들의 긴축 우려는 당분간 지속될 것으로 생각하며 주식시장 상승을 제한할 가능성이 있다고 판단합니다. 그러나 호전 추세를 보이고 있는 미국의 소비심리 및 경제지표들은 관련 종목을 중심으로 연초 시장에 긍정적인 영향을 줄 것으로 판단하며 이를 바탕으로 상승추세가 이어질 것으로 전망합니다. 다만 상승추세 지속에 따른 부담과 원화의 빠른 절상으로 인해 외국인의 매수세가 둔화되며 분기 중반 이후 추가적인 상승에 제한을 받을 가능성이 있고, 2월 초 이후 유로존 국가채무 위험이 다시 부각되며 변동성이 더욱 확대될 가능성이 있다고 예상합니다.

2011년 핵심 테마는 글로벌 경쟁력과 이익의 안정성을 갖춘 성장주, 전체적인 기업이익 대비 주가수준 상승에 따라 목표주가 이상 달성 가능성이 있는 종목군으로 전망합니다. 이에 따라 글로벌 경쟁력을 갖춘 정유, 화학, 반도체 업종과, 지주회사 종목들의 편입비를 상향할 계획입니다. 또한 정부의 목표 경제성장률 달성을 위한 정책과 해외수주 모멘텀이 기대되는 건설업종의 비중을 상향할 계획입니다. 유동성의 팽창과 이에 따른 위험자산 선호 현상으로 연초 중소형 종목도 주가 상승 가능성이 있다고 예상하며 이를 활용하여 보유중인 중소형 종목들을 1월 중 매도할 계획입니다.

### ▶ 기간수익률

#### 마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	7.37	16.01	24.41	34.63	33.77
비교지수	4.41	13.91	22.16	24.07	23.71

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	7.24	15.57	23.46	33.09	31.73
비교지수	4.41	13.91	22.16	24.07	23.71

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	7.20	15.42	23.11	32.53	30.98
비교지수	4.41	13.91	22.16	24.07	23.71

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	7.21	15.45	23.19		
비교지수	4.41	13.91	22.16		

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C0(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
집합투자기구	7.22	15.49	23.28	32.80	31.32
비교지수	4.41	13.91	22.16	24.07	23.71

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	33.77			
비교지수	23.71			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구	31.73			
비교지수	23.71			

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100%

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구	30.98			
비교지수	23.71			

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 증권투자신탁C0(주식)

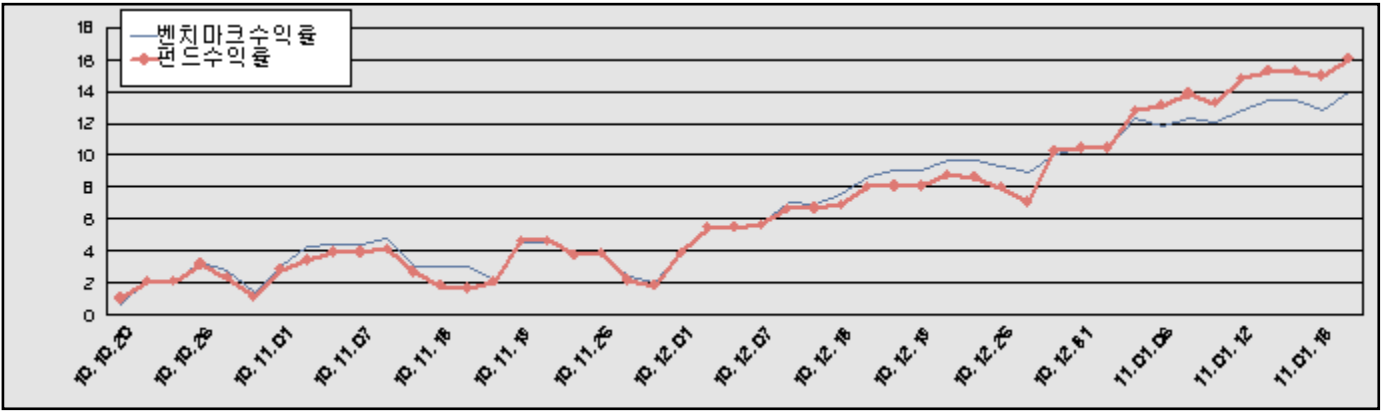
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
집합투자기구	31.32			
비교지수	23.71			

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	897	0	0	0	0	0	0	0	0	1	50	948
전기손익	354	0	0	0	0	0	0	0	0	1	-3	352

3. 자산현황

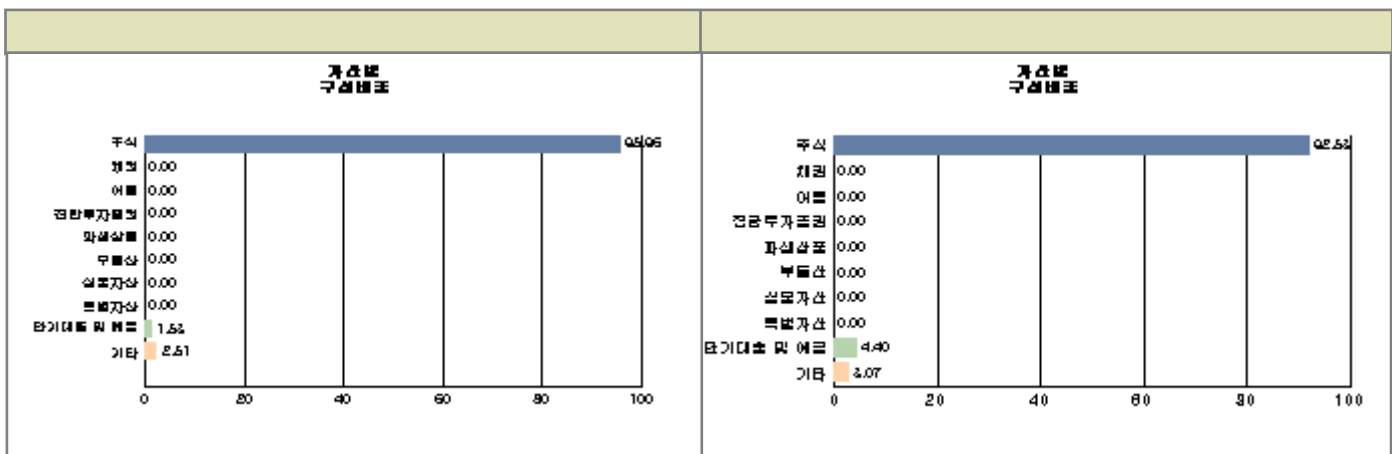
▶ 자산구성현황

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	6,764 (92.53)	0	0	0	0	0	0	0	0	322 (4.41)	224 (3.07)	7,311 (100.00)
합계	6,764 (92.53)	0	0	0	0	0	0	0	0	322 (4.41)	224 (3.07)	7,311 (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)

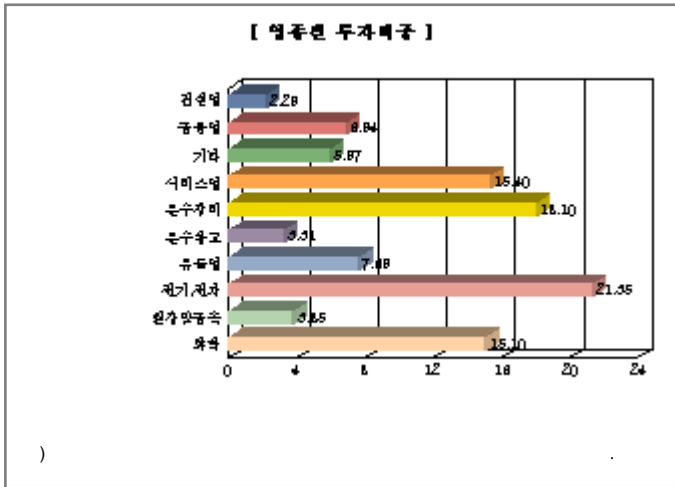
주식투자 상위 10종목

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
삼성전자	13.28	현대차	5.99
LG화학	4.36	하이닉스	4.12
LG	4.07	삼성물산	3.83
현대중공업	3.38	두산	3.24
GS	2.93	기아차	2.82

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

업종별 투자비중

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
전기, 전자	21.35	운수장비	18.10
서비스업	15.40	화학	15.10
유통업	7.69	금융업	6.94
철강및금속	3.85	운수참고	3.31
건설업	2.29	기타	5.97



▶ 투자대상 상위 10종목

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	12.29	2	주식	현대차	5.55
3	단기대출및예금	예금	4.41	4	주식	LG화학	4.04
5	주식	하이닉스	3.81	6	주식	LG	3.76
7	주식	삼성물산	3.55	8	주식	현대중공업	3.13
9	주식	두산	3.00	10	주식	GS	2.71

( <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	901	898,297,000	13.28
현대차	2,101	405,493,000	5.99
LG화학	720	295,200,000	4.36
하이닉스	9,996	278,388,600	4.12
LG	3,157	274,974,700	4.07

※ 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		322,281,800	2.30		

※ 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	10	861,978	서울대학교 대학원 경영학 석사, KAIST Techno MBA, CFA 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부 現 마이더스에셋자산운용 대표이사 ☞ 주요운용펀드: 마이더스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	운용역 1976년	10	861,978	성균관대학교 경제학과 대우증권, 유리자산운용 現 마이더스에셋자산운용 주식운용본부 과장 ☞ 주요운용펀드: 마이더스 그린SRI 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	1	0.01	
매매/중개수수료	6	0.13	9	0.14	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
집합투자업자	2	0.16	2	0.16	
투자매매/중개업자	2	0.23	3	0.23	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
보수 합계	4	0.40	6	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	5	0.16	6	0.16	
투자매매/중개업자	12	0.38	13	0.38	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
보수 합계	18	0.55	20	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	1	0.16	2	0.16	
투자매매/중개업자	2	0.34	4	0.34	
신탁업자	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.01	
보수 합계	3	0.52	6	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	0.01	
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	0.02	0.50	0.02	0.50
당기	0.04	0.55	0.04	0.55

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	1.62	0.49
당기	1.60	0.00	1.64	0.55

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.20	0.00	2.22	0.51
당기	2.20	0.00	2.24	0.55

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.05	0.00	2.08	0.48
당기	2.05	0.00	2.09	0.55

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 집합투자기구		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.90	0.00	1.92	0.50
당기	1.90	0.00	1.94	0.55

- 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 회전율

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주,원,%)

매수		매도		매매회전율	
수량	금액	수량	금액	3개월	연환산
115,083	4,513,123,430	151,405	4,034,465,920	66.87	268.21

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