

자 산 운 용 보 고 서

공지사항

고객님이 가입하신 펀드는 『자본시장과 금융투자업에 관한 법률(신규 설정)』의 적용을 받습니다.

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)의 자산운용사인 마이다스에셋자산운용이 작성하여 펀드자산보관자(신탁업자)인 '한국씨티은행'의 확인을 받아 판매회사를 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드자산보관자(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.

각종 보고서 확인 : 마이다스에셋자산운용 <http://www.midasasset.com>
금융투자협회 <http://dis.fundservice.net>

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

위험등급 : 1등급

펀드명칭		금융투자협회 펀드코드	
마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)		93983	
마이다스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)		93984	
마이다스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)		93985	
마이다스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)		93986	
마이다스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)		93989	
펀드의 종류	투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형	최초설정일	2009-04-20
운용기간	3개월(2011-01-20 ~ 2011-04-19)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
판매회사	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, 사회적책임 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
자산 총액	7,310,859,891	7,908,529,921	8.18
부채 총액	231,768,421	130,522,461	-43.68
순자산총액	7,079,091,470	7,778,007,460	9.87
기준가격	1,892.35	1,939.55	2.49

(단위 : %)

(Class) 가	전기말	당기말	증감률
-----------	-----	-----	-----

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	1,330.88	1,000.00	2.11
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	1,325.25	1,000.00	1.96
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	1,314.43	1,000.00	2.00
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	1,327.98	1,000.00	2.08

) 가 가 (), () () 가

※ 분배금내역

(단위 : 백만원, 좌)

분배금 지급일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2011-04-19	541	1,507,043,820	1,358.94	1,000.00	그린SRI 증권A1(주식)
2011-04-19	0	4,010,218,441	1,939.55	1,939.55	그린SRI 증권(주식)
2011-04-19	333	948,042,879	1,351.29	1,000.00	그린SRI 증권C1(주식)
2011-04-19	39	108,442,955	1,355.63	1,000.00	그린SRI 증권Ce(주식)
2011-04-19	1,085	3,183,296,971	1,340.75	1,000.00	그린SRI 증권C2(주식)

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 2.11%이며 종합주가지수는 0.33% 상승하여 펀드수익률은 비교지수대비 1.78% 상회하였습니다. (Class A1기준) 동 기간 동안 업종별로는 에너지, 화학, 조선, 자동차, 보험업종의 편입비중을 높였고 철강, 건설, 음식료 업종의 편입비중을 낮추었습니다.

-적극적인 자산배분과 중기 상승추세 확산에 따른 양호한 성과: 글로벌 유동성의 국내 주식시장 유입과 미국의 경기지표 개선 기대감을 바탕으로 주식시장의 중기 상승추세가 지속될 것이라고 판단하였습니다. 하지만 1월말 이후 아시아 국가들의 긴축과 단기 유동성 이탈이 상승피로도가 누적된 시장의 변동성을 확대할 것이라는 판단에 선제적으로 주식편입비중을 낮춘 후 가격조정 후 다시 편입비중을 늘리는 적극적인 자산배분을 실행 하였던 점이 양호한 성과에 일정부분 기여하였습니다.

-에너지, 화학, 조선업종의 양호한 성과: 좋은 영업환경을 보이는 업종 내에서 중장기 성장성을 갖춘 종목군의 비중을 상향하였습니다. 이러한 측면에서 편입 비중을 높은 SK에너지, 금호석유, 락앤락, 대우조선해양, 현대차, 다음 등이 펀드 성과 제고에 기여하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

-향후 주식시장은 중동, 북아프리카 지역의 지정학적 리스크, 인플레이션 우려로 인한 외국인 대규모 매도세가 진정됨에 따른 4월의 주가 상승세는 5월초까지 이어질 가능성이 높다고 판단되나, QE2 종료 이후 글로벌 유동성 훼손에 대한 우려가 차익실현 욕구와 맞물리며 5월 중순 이후 변동성이 큰 폭으로 확대될 것으로 예상됩니다: 4월 시장을 주도했던 정유, 화학, 자동차섹터 중심의 상승세가 기타 업종으로 확산되며 5월 초 시장은 상승세가 좀 더 이어질 것으로 보여집니다. 5월 중순 이후 실적 시즌 마감에 따른 호재의 기 반영과 상승피로감으로 상승 탄력이 떨어지면서 변동성 확대 국면에 접어들 것으로 보이며 이 국면에서 QE2 종료에 따른 우려가 부각될 경우 시장은 제한적이지만 단기적으로 가파른 하락세를 보일 수도 있을 것으로 예상하고 있습니다. 5월 중순 이후 시장은 가격 및 기간조정이 동반되는 흐름을 전망하고 있습니다.

-상승 종목군의 확산 과정에 대응한 이후 변동성 확대 및 단기 조정에 대비한 자산배분 전략 : (1)기존 시장을 주도했던 주도주군과 상승 확산이 예상되는 업종을 균형 있게 편입하며 5월초 주식 고 편입비율을 유지한 이후 5월 중순 이후 점차적으로 편입비율을 축소할 계획입니다. (2) 중국의 긴축우려 완화와 함께 소비심리 회복시 정책이 뒷받침하는 소비관련 종목들이 부각될 것으로 기대하여 중국 유통관련 주식들의 편입을 확대할 계획입니다. (3) 계절적 요인과 함께 구조적 요인으로 운용자산 증가 등으로 점차 개선되고 있는 보험업종에 대한 편입을 확대할 계획입니다. (4) 6월 이후 시장의 중기 상승추세가 다시 재개될 것으로 예상하며 조정기를 활용하여 자체적인 성장 가능성과 실적 회복 가능성을 보유한 종목군을 발굴하여 선별적으로 편입할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)	8.23	2.49	18.90	27.51	37.98
마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	8.10	2.11	18.01	26.06	35.89
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	8.06	1.96	17.68	25.53	35.13
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	8.07	2.00	17.76	25.66	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	8.11	2.08	17.90	25.85	35.56
비교지수	7.14	0.33	14.29	22.56	24.48

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100% 자펀드 기준의 비교지수입니다.

* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

▶ 연평균 수익률

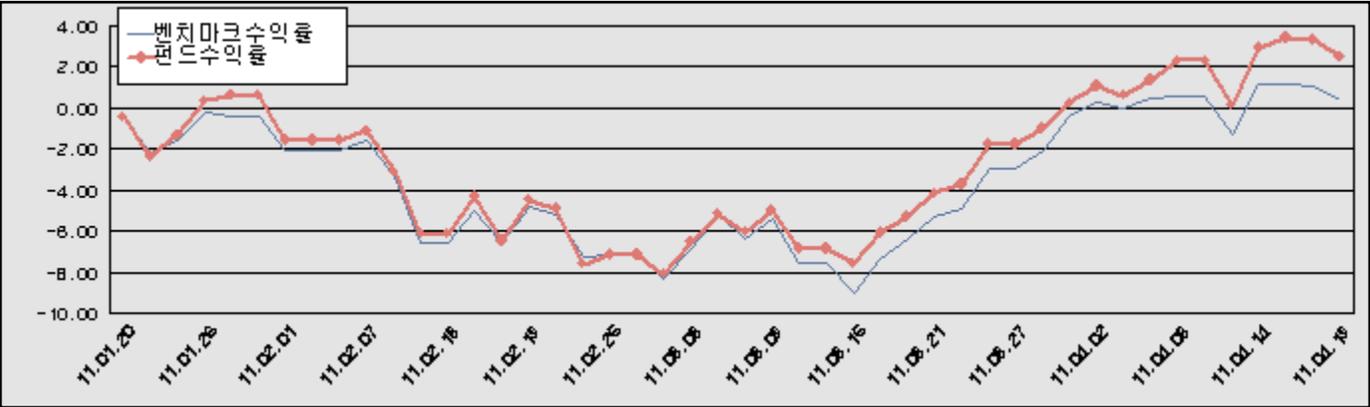
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)	37.98	39.27	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	35.89	37.14	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	35.13	36.34	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	-	-	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	35.56	36.71	-	-
비교지수	24.48	26.38	-	-

비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100% 자펀드 기준의 비교지수입니다.

* 위 투자실적은 과거 성과를 나타낼 뿐 미래의 운용성과를 보장하는 것은 아닙니다.

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)



비교지수(Bench Mark) = KOSPI 100% 자펀드 기준의 비교지수입니다.

* 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	231	-	-	-	-	-	-	-	-	1	-14	218
전기손익	897	-	-	-	-	-	-	-	-	1	50	948

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	7,452 (94.22)	-	-	-	-	-	-	-	-	248 (3.13)	209 (2.65)	7,909 (100.00)
합계	7,452 (94.22)	-	-	-	-	-	-	-	-	248 (3.13)	209 (2.65)	7,909 (100.00)

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

▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	주식	삼성전자	2	주식	현대차
3	주식	한화케미칼	4	주식	하이닉스
5	주식	SK이노베이션	6	주식	기아차
7	주식	현대중공업	8	단기대출및예금	예금
9	주식	OCI머티리얼즈	10	주식	LIG손해보험

*

(<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	919	804,125,000	10.79
현대차	1,762	397,331,000	5.33
한화케미칼	6,925	355,945,000	4.78
하이닉스	9,676	317,372,800	4.26
SK이노베이션	1,348	295,886,000	3.97

※ 비중 : 주식 총액중 해당 종목이 차지하는 비중

▶ 채권

▶ 어음

▶ 집합투자증권

▶ 장내파생상품

▶ 장외파생상품

▶ 부동산(임대)

▶ 부동산(자금대여 및 차입)

▶ 특별자산

▶ 단기대출 및 예금

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

종류	금융기관	대출(예금)일자	대출(예금)액	적용금리	만기일	비고
예금	한국씨티은행		247,591,606	2.53		

※ 상위 5개 종목만 기재함.

▶ 기타

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 운용전문인력

(단위 : 개, 백만원)

성명	운용개시일	직위	운용중인 다른 펀드 현황		주요 경력 및 운용내역(최근5년)	협회등록번호
			펀드 수	운용 규모		
허필석	2009-04-20	대표이사 1967년	21	742,309	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 대표이사 주요운용펀드: 마이더스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	운용역 1976년	21	742,309	성균관대학교 경제학과, 대우증권, 유리자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용본부 차장 주요운용펀드: 마이더스그린SRI증권투자신탁(주식)	08-02002-0043

가 (1) (389,043) (: ,)

가 (http://dis.kofia.or.kr)

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원, %)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	-	-	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	-	-	
일반사무관리회사	-	-	-	-	
보수 합계	-	-	-	-	
기타비용**	1	0.01	1	0.01	
매매/중개수수료	9	0.14	18	0.25	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	2	0.16	3	0.16	
판매회사	3	0.23	4	0.21	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	6	0.40	7	0.38	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	6	0.16	6	0.15	
판매회사	13	0.38	13	0.36	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	20	0.55	19	0.52	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	2	0.16	2	0.16	
판매회사	4	0.34	5	0.32	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	6	0.52	8	0.49	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	0	0.16	0	0.15	
판매회사	0	0.30	0	0.24	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.01	0	0.00	
보수 합계	0	0.48	1	0.41	
기타비용**	-	-	-	-	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

* 펀드의 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 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.04	0.55	0.04	0.55
당기	0.03	1.01	0.03	1.01

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.60	0.00	1.64	0.55
당기	1.55	0.00	1.58	1.01

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.20	0.00	2.24	0.55
당기	2.13	0.00	2.16	1.02

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.05	0.00	2.09	0.55
당기	2.00	0.00	2.03	1.00

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.90	0.00	1.94	0.55
당기	1.66	0.00	1.69	1.02

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 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
230,060	9,236,150,650	198,706	8,798,115,450	125.84	516.07

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주가가액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율.

※ 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료(0.1%내외) 및 증권거래세(매도시 0.3%) 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드비용이 증가합니다.

▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

2010-07-20 ~ 2010-10-19	2010-10-20 ~ 2011-01-19	2011-01-20 ~ 2011-04-19
37.68	57.70	125.84