

자 산 운 용 보 고 서

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)의 집합투자업자인 마이다스에셋자산운용이 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 : 마이다스에셋자산운용 <http://www.midasasset.co.kr> / 02-3787-3500
 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 증권투자신탁C3(주식)		93987	
마이다스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)		93989	
펀드의 종류	투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형	최초설정일	2009-04-20
운용기간	3개월(2011-04-20 ~ 2011-07-19)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
판매회사	하나대투증권 대우은행 대우증권 한국외환은행 신한금융투자 NH투자증권 비에스투자증권 키움닷컴증권		
상품의 특징	본 상품은 주식형 펀드로서 약관상 주식에 60% 이상 투자하고 있으며 종합주가지수를 비교지수로 하고 있습니다. 녹색성장과 관련된 투자기회를 선정하고, 사회책임 우수기업에 장기투자하면서, 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 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	7,908,529,921	5,631,627,726	-28.79
부채 총액	130,522,461	117,395,971	-10.06
순자산총액	7,778,007,460	5,514,231,755	-29.10
기준가격	1,939.55	1,943.95	0.23

(단위 : %)

(Class) 가	전기말	당기말	증감률
마이다스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	1,358.94	998.30	-0.17
마이다스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	1,351.29	996.81	-0.32

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	1,340.75	997.20	-0.28
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)	-	962.16	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	1,355.63	998.30	-0.17

) 가 가 (), () 가 () 가

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 -0.17%이며(Class A1기준) 동기간 종합주가지수는 0.35% 상승하여 펀드수익률은 벤치마크 대비 0.52% 하회하였습니다. 동 기간 동안 업종별로는 에너지, 화학, 조선, 자동차업종의 편입비중을 높였고 철강, 건설, 음식료 업종의 편입비중을 낮추었습니다.

비교지수 대비 펀드 성과가 저조했던 요인은 다음과 같습니다.

첫째: 성과가 좋았던 건설, 음식료 업종의 적은 편입에 따른 성과부진: 부동산시장 부진과 해외수주 지연 등의 이유로 편입비를 낮췄던 건설업종과 정부의 물가 규제를 이유로 편입비를 낮춘 음식료업종이 예상과는 달리 시장대비 성과가 양호하여 펀드 성과 부진에 영향을 주었습니다.

둘째: 중소형주의 상대적강세와 대형주 위주 편입에 따른 성과 부진- 동 기간 동안 이슈였던 유럽주변국가들의 과도한 채무위험과 미국의 정부채무한도 및 신용등급 하향위험으로 인해 국내증시에서는 외국인 매도세가 나타나면서 수급상황이 악화되었으며 이러한 시장환경이 중소형주의 저 평가와 맞물리며 중소형주 지수의 상대강세 현상이 나타났습니다. 하지만 마이더스그린SRI펀드는 안정적인 운용을 추구하는 펀드의 특성상 대형주 위주로 편입이 되어있으며 이에 따라 상대적으로 부진한 성과를 시현하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

미국 정부채무한도 조정과 신용등급 하향에 따른 우려가 있지만 주식시장은 유럽주변국가들의 채무위험 해결 분위기와 미국 경기지표들의 개선 기대감으로 인해 점차 안정화될 것으로 예상됩니다. 악재해소와 경제지표 개선에 따른 시장 상승전환에 초점을 맞춰 하반기 전략 종목군을 적극적으로 편입할 계획입니다. 첫째로 저수바닥 재확인 과정을 거치는 동안 단기 주식 편입비율 확대 및 하반기 전략 종목군의 저가매수 기회로 상을 계획하며 둘째, 중국의 긴축우려 완화와 함께 소비심리 회복시 정책이 뒷받침하는 소비관련 종목들이 부각될 것으로 기대하며 중국관련 유통주식들의 편입을 확대할 계획입니다 셋째, 실적시즌을 앞두고 추정치의 상향추세가 이어지는 종목과 함께 충분한 하향조정으로 주가가 과 매도된 종목들(주로 IT)도 단기 편입할 계획입니다. 넷째 하반기 초는 업종 편중보다는 상승업종 확대(철강, 금융, IT) 흐름을 예상하여 균형 있는 포트폴리오를 구축할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근	최근	최근	최근	최근 1년
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)	6.15	0.23	2.73	19.17	27.80
마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	6.03	-0.17	1.93	17.81	25.85
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	5.98	-0.32	1.64	17.31	25.13
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	5.99	-0.28	1.72	17.43	25.31
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)	6.00	-	-	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	6.03	-0.17	1.91	17.70	25.63
비교지수	4.84	0.35	0.69	14.69	22.99

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

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

▶ 연평균 수익률

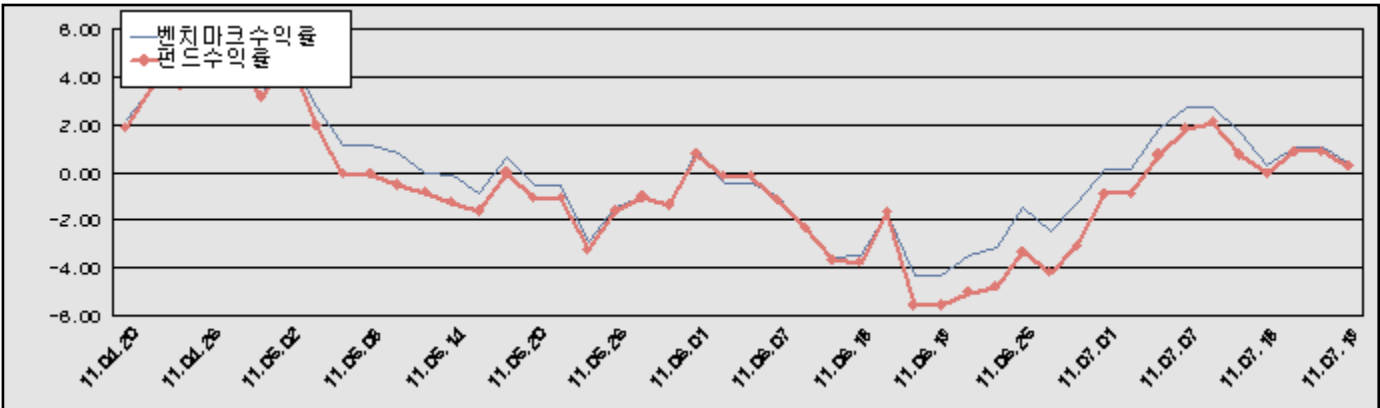
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)	27.80	32.87	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	25.85	30.84	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	25.13	30.08	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	25.31	-	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)	-	-	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	25.63	30.50	-	-
비교지수	22.99	21.62	-	-

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	-5	-	-	1	-	-	-	-	-	4	-17	-17
전기손익	231	-	-	-	-	-	-	-	-	1	-14	218

3. 자산현황

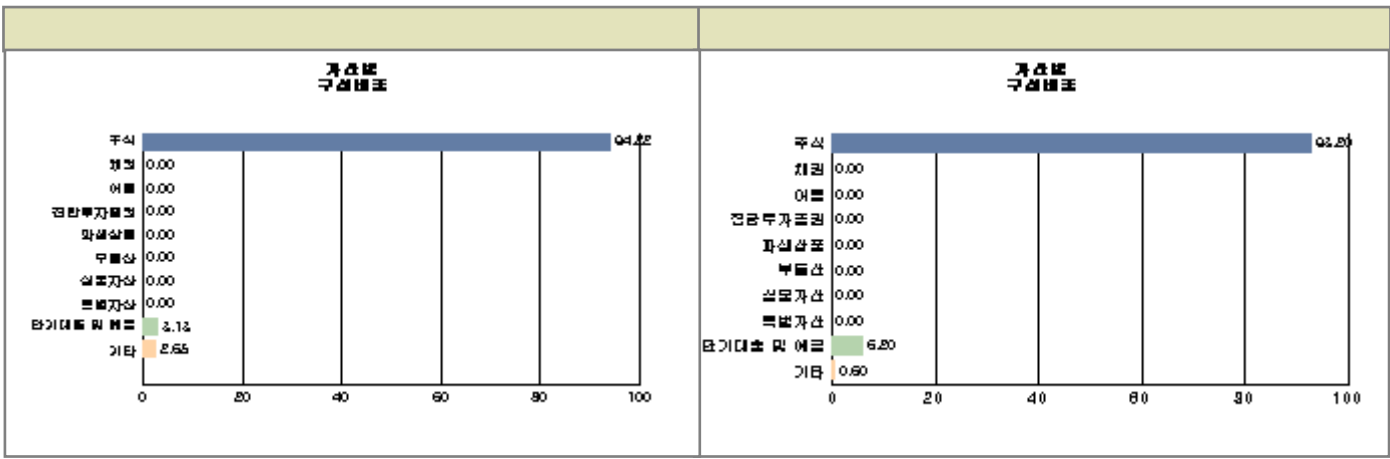
▶ 자산구성현황

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	5,249 (93.20)	-	-	-	-	-	-	-	-	349 (6.20)	34 (0.60)	5,632 (100.00)
합계	5,249 (93.20)	-	-	-	-	-	-	-	-	349 (6.20)	34 (0.60)	5,632 (100.00)

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



주) 위 자산구성 그래프는 클래스운용펀드 기준의 구성현황입니다.

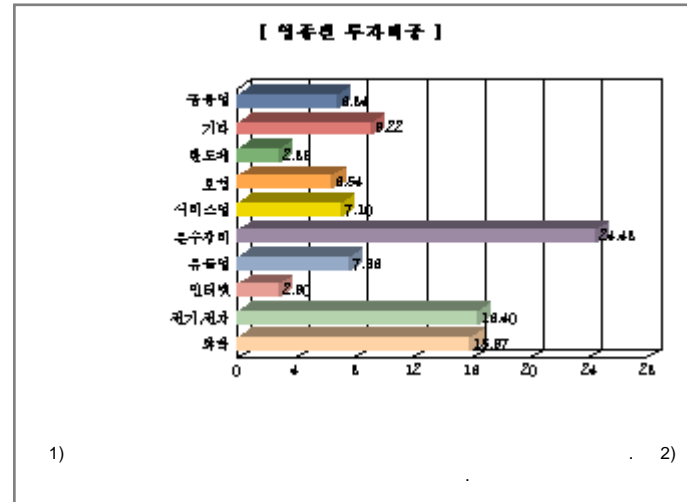
▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식) 주식투자 상위 10종목

종목	비중(%)	종목	비중(%)
현대차	7.64	삼성전자	7.58
LIG손해보험	5.56	현대모비스	5.31
현대중공업	5.23	기아차	3.57
삼성물산	3.56	GS	3.38
S-Oil	3.16	다음	2.90

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식) 업종별 투자비중

종목	비중(%)	종목	비중(%)
운수장비	24.48	전기, 전자	16.40
화학	15.97	유통업	7.66
서비스업	7.10	금융업	6.84
보험	6.54	인터넷	2.90
반도체	2.89	기타	9.22



▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중
1	주식	현대차	2	주식	삼성전자
3	단기대출및예금	예금	4	주식	LIG손해보험
5	주식	현대모비스	6	주식	현대중공업
7	주식	기아차	8	주식	삼성물산
9	주식	GS	10	주식	S-Oil

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

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

■ 상위 5개 종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 주, 원, %)

종목	보유수량	평가금액	비중
현대차	1,722	401,226,000	7.64
삼성전자	484	397,848,000	7.58
LIG손해보험	10,020	291,582,000	5.56
현대모비스	708	278,598,000	5.31
현대중공업	611	274,644,500	5.23

※ 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		349,402,933	2.76		

※ 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	7	833,964	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이더스에셋자산운용 대표이사 ☞주요운용펀드:마이더스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	차장 1976년	7	833,964	성균관대학교 경제학과, 대우증권, 유리자산운용, 現 마이더스에셋자산운용 주식운용본부 차장 ☞주요운용펀드:마이더스그린SRI증권투자신탁(주식)	08-02002-0043

가 (http://dis.kofia.or.kr)
가
:
: (1) (389,043) (: ,)

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	0	0.01	
매매/중개수수료	18	0.25	9	0.14	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	3	0.15	3	0.16	
판매회사	4	0.21	5	0.22	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	7	0.38	8	0.40	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A2(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	6	0.15	2	0.16	
판매회사	13	0.36	5	0.37	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	19	0.52	7	0.55	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	2	0.16	5	0.16	
판매회사	5	0.32	11	0.34	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	8	0.49	16	0.51	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	0	0.16	
판매회사	-	-	1	0.29	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	0	0.01	
일반사무관리회사	-	-	0	0.00	
보수 합계	-	-	1	0.46	
기타비용**	-	-	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C6(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	0	0.15	0	0.16	
판매회사	0	0.24	0	0.22	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
보수 합계	1	0.41	1	0.40	
기타비용**	-	-	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

* 펀드의 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 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.03	1.01	0.03	1.01
당기	0.02	0.55	0.02	0.55

마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.55	0.00	1.58	1.01
당기	1.60	0.00	1.62	0.58

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	2.13	0.00	2.16	1.02
당기	2.20	0.00	2.22	0.58

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.99	0.00	2.02	0.99
당기	2.05	0.00	2.07	0.52

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	0.00	0.00	0.00	0.00
당기	1.86	0.00	1.88	0.56

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.65	0.00	1.68	1.02
당기	1.60	0.00	1.62	0.57

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 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
94,898	47,509,068,50	135,288	70,871,973,50	111.12	450.67

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 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 매매회전율 추이

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : %)

2011-04-20 ~ 2011-07-19	2011-01-20 ~ 2011-04-19	2010-10-20 ~ 2011-01-19
111.12	125.84	66.87