

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 증권투자신탁C3(주식)		93987	
마이다스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)		93989	
펀드의 종류	투자신탁/증권(주식형)/추가형/개방형/종류형	최초설정일	2009-04-20
운용기간	3개월(2011-07-20 ~ 2011-10-19)	존속기간	추가형
자산운용사	마이다스에셋자산운용		
펀드재산보관(신탁업자)	한국씨티은행	일반사무관리회사	SC펀드서비스
판매회사	하나대투증권 대구은행 대우증권 한국외환은행 신한금융투자 NH투자증권 비에스투자증권 키움닷컴증권		
상 품 의 특 징	본 상품은 주식형 펀드로서 약관상 주식에 60% 이상 투자하고 있으며 종합주가지수를 비교지수로 하고 있습니다. 녹색성장과 관련된 투자기회를 선정하고, 사회책임 우수기업에 장기투자하면서, 주가대비 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	5,631,627,726	5,162,437,382	-8.33
부채 총액	117,395,971	24,725,863	-78.94
순자산총액	5,514,231,755	5,137,711,519	-6.83
기준가격	1,943.95	1,680.51	-13.55

(단위 : %)

(Class) 가	전기말	당기말	증감률
마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	998.30	859.54	-13.90
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	996.81	856.95	-14.03
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	997.20	857.62	-14.00
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)	962.16	827.81	-13.96
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	998.30	859.54	-13.90

) 가 가 (), () () 가

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

동 기간 동안 펀드 수익률은 -13.90%이며(Class A1기준) 종합주가지수는 12.88% 하락하여 펀드수익률은 종합주가지수 대비 1.02% 낮은 성과를 기록하였습니다. 동 기간 동안 시장은 글로벌 경기침체에 대한 우려와 유럽 주변국가들의 부도위험이 재 부각되며 큰 폭의 변동성과 함께 약세 흐름이 지속되었습니다. 업종별로는 화장품, 음식료, 제약업종의 편입비중을 높였고 화학, 조선, IT업종의 편입비중을 낮추었습니다. 비교지수 대비 성과가 저조한 이유는 다음과 같습니다.

첫째, 8월초 시장 급락 국면에서의 높은 주식비중으로 인한 부진한 성과: 7월 말 시장이 어느 정도 안정화 국면에 있었기 때문에 주식비중을 높이 가져가고 있었습니다. 하지만 8월초 시장이 예측하기 어려울 만큼 빠른 속도로 큰 폭의 하락을 하였기 때문에 주식비중의 축소 대응을 신속히 하지 못했습니다.

둘째, 8월초 시장 급락 국면에서 경기에 민감한 주식의 높은 비중으로 인한 부진한 성과 : 7월 말까지 기업실적이나 업황이 가장 양호했던 주도업종은 화학, 조선, 자동차 등 경기에 민감한 업종들이었습니다. 펀드에서는 이러한 업종들의 비중이 시장대비 높은 편이었는데 8월초 글로벌 경기침체에 대한 우려가 확산되며 시장이 빠른 속도로 하락을 하는 과정에서 시장대비 비중이 높았던 경기 민감 업종들의 수익률이 매우 부진하였으며 경기 방어종목들의 투자비중이 시장대비 낮았던 것이 부진한 성과의 원인이 되었습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

여전히 시간이 필요한 유럽 주변국가들의 부도위험 해결을 위한 재정 건전성 회복과 글로벌 경기침체 우려에 따른 약세 흐름 속에서의 큰 폭의 변동성장세 이어지다가 연말 지수 바닥확인 과정 예상: 유럽 주변국가들의 부도위험 문제를 해결하기 위해 유럽내 여러 정책논의가 진행 중이지만 근본적인 문제는 재정 건전성의 악화에 있으며 이를 근본적으로 해결하기 위해서는 구조조정이라는 시장의 생각보다 보다 긴 문제해결의 시간이 필요합니다. 미국과 유럽의 주요경제 지표가 여전히 침체 신호를 보내고 있는 가운데 현재 글로벌 경제의 가장 큰 버팀목인 중국의 여전히 긴축 및 향후 경기둔화 우려가 새롭게 시장에 부담으로 작용하고 있습니다. 높아진 가격 매력 속에서 단기적으로는 큰 폭의 단기반등도 나올 수는 있겠지만 시장은 연말까지 약세흐름을 지속할 것으로 전망합니다. 이후 연말 반등을 모색하기 위한 바닥확인 과정이 진행될 것으로 전망합니다.

여전히 불확실한 거시경제 상황에 대비하여 거시경제 영향을 적게 받는 업종의 비중을 높게 가져가지만 연말로 갈수록 밸류에이션 저점에 도달하였거나 내년 성장 모멘텀을 보유한 종목들에 대한 편입비를 확대할 계획 : (1) 거시경제의 영향을 덜 받는 업종(제약, 인터넷/게임업종)의 주식 투자비중을 높게 유지하는 가운데 유동성이 뒷받침되는 종목군을 중심으로 적극적인 트레이딩으로 초과수익을 추구할 계획입니다. (2) 어닝시즌을 앞두고 추정치의 상향추세가 이어지는 종목과 함께 충분한 하향조정으로 주가가 과 매도된 종목들도 단기 편입할 계획입니다. (3) 시장은 여전히 약세흐름이 진행될 가능성이 높다고 판단하여 포트폴리오 전체적으로는 업종 중립적으로 대응할 계획입니다. (4) 연말로 갈수록 밸류에이션 저점에 도달하였거나 내년 성장 모멘텀을 보유한 종목들에 대한 비중을 확대하여 시장 상승전환에 대비할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위 : %)

구분	최근 1개월	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 1년
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)	3.24	-13.55	-13.36	-11.19	3.02
마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	3.12	-13.90	-14.05	-12.23	1.44
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	3.07	-14.03	-14.30	-12.62	0.85
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	3.08	-14.00	-14.24	-12.52	1.00
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)	3.09	-13.96	-	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	3.12	-13.90	-14.05	-12.26	1.34
비교지수	1.92	-12.88	-12.57	-12.28	-0.08

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

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

▶ 연평균 수익률

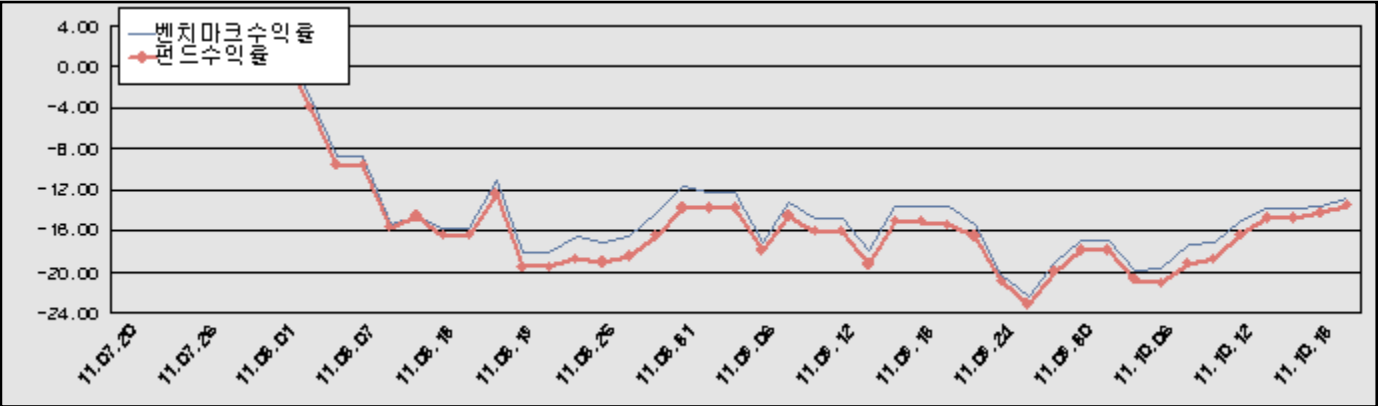
(단위 : %)

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식)	3.02	14.47	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)	1.44	12.72	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C1(주식)	0.85	12.07	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)	1.00	-	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)	-	-	-	-
마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)	1.34	12.47	-	-
비교지수	-0.08	6.09	-	-

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	-697	-	-	-29	-	-	-	-	-	2	-10	-734
전기손익	-5	-	-	1	-	-	-	-	-	4	-17	-17

3. 자산현황

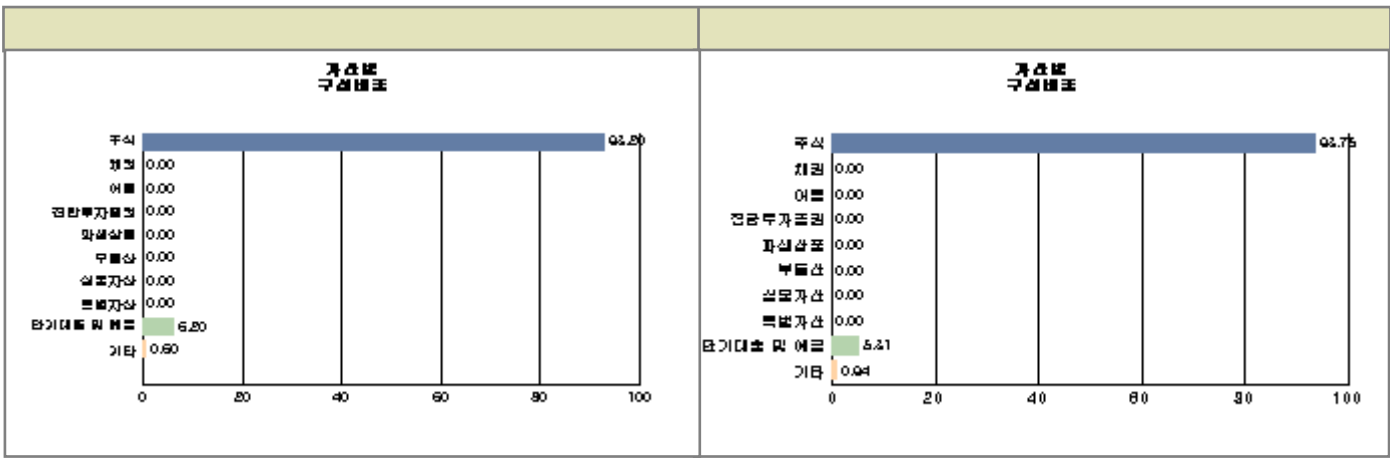
▶ 자산구성현황

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	4,840 (93.75)	-	-	-	-	-	-	-	-	274 (5.31)	48 (0.94)	5,162 (100.00)
합계	4,840 (93.75)	-	-	-	-	-	-	-	-	274 (5.31)	48 (0.94)	5,162 (100.00)

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



주) 위 자산구성 그래프는 클래스운용펀드 기준의 구성현황 입니다.

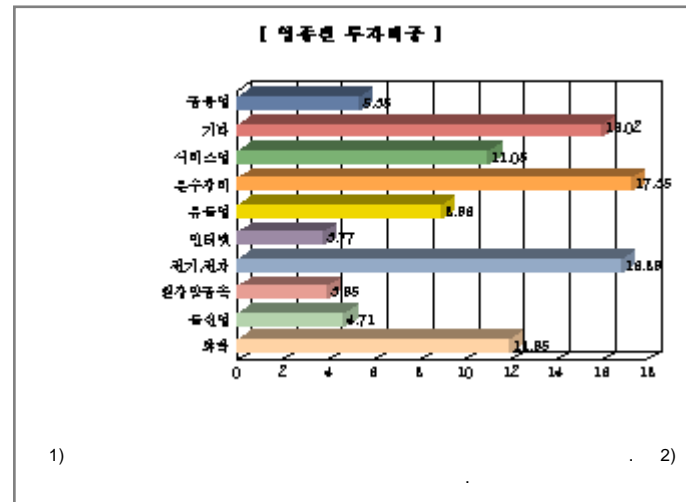
▶ 업종별, 국가별 투자비중

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식) 주식투자 상위 10종목

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
삼성전자	12.65	현대차	5.26
현대모비스	4.44	다음	2.97
기아차	2.97	LG화학	2.46
LIG손해보험	2.43	NHN	2.42
현대중공업	2.36	SK텔레콤	2.09

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식) 업종별 투자비중

종 목	비 중(%)	종 목	비 중(%)
운수장비	17.35	전기, 전자	16.89
화학	11.95	서비스업	11.05
유통업	8.96	금융업	5.35
통신업	4.71	철강및금속	3.95
인터넷	3.77	기타	16.02



▶ 투자대상 상위 10종목

마이더스 그린SRI 증권투자신탁(주식) (단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	주식	삼성전자	11.86	2	단기대출및예금	예금	5.31
3	주식	현대차	4.93	4	주식	현대모비스	4.16

5	주식	다음	2.78	6	주식	기아차	2.78
7	주식	LG화학	2.31	8	주식	LIG손해보험	2.28
9	주식	NHN	2.27	10	주식	현대중공업	2.21

* (<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	691	612,226,000	12.65
현대차	1,150	254,725,000	5.26
현대모비스	620	214,830,000	4.44
다음	983	143,714,600	2.97
기아차	1,940	143,560,000	2.97

※ 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		274,063,172	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	932,229	서울대학교 대학원 경영학석사, KAIST Techno MBA, CFA, 장기신용은행 금융공학팀, 삼성증권 자금부, 現 마이다스에셋자산운용 대표이사 주요운용펀드: 마이다스블루칩배당증권투자신탁1호(주식)	00-02002-0011
최종혁	2009-04-20	차장 1976년	7	932,229	성균관대학교 경제학과, 대우증권, 유리자산운용, 現 마이다스에셋자산운용 주식운용본부 차장 주요운용펀드: 마이다스그린SRI 증권투자신탁(주식)	08-02002-0043

)
가
:
:(1) (517,586) (: ,)

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

마이다스 그린SRI 증권투자신탁(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	-	-	-	-	
판매회사	-	-	-	-	
펀드재산보관(신탁업자)	-	-	-	-	
일반사무관리회사	-	-	-	-	
보수 합계	-	-	-	-	
기타비용**	0	0.01	0	0.00	
매매/중개수수료	9	0.14	7	0.14	

마이다스 그린SRI 증권투자신탁A1(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	3	0.16	3	0.16	
판매회사	5	0.22	4	0.23	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	8	0.40	8	0.40	
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	1	0.16	
판매회사	5	0.37	3	0.38	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	7	0.55	5	0.55	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C2(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	5	0.16	2	0.16	
판매회사	11	0.34	5	0.34	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	16	0.51	7	0.52	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	0	0.16	1	0.16	
판매회사	1	0.29	2	0.30	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	1	0.46	2	0.48	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C6(주식)

(단위 : 백만원,%)

구분	전기		당기		비고
	금액	(%)*	금액	비율(%)*	
자산운용사	0	0.16	0	0.16	
판매회사	0	0.22	0	0.23	
펀드재산보관(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
일반사무관리회사	0	0.00	0	0.01	
보수 합계	1	0.40	1	0.40	
기타비용**	0	0.00	0	0.00	
매매/중개수수료	-	-	-	-	

* 펀드의 순자산평잔 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	0.02	0.55	0.02	0.55
당기	0.01	0.54	0.01	0.54

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	1.62	0.58
당기	1.60	0.00	1.61	0.55

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	2.22	0.58
당기	2.20	0.00	2.21	0.56

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	2.07	0.52
당기	2.05	0.00	2.06	0.54

마이더스 그린SRI 증권투자신탁C3(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.86	0.00	1.88	0.56
당기	1.90	0.00	1.91	0.50

마이더스 그린SRI 증권투자신탁Ce(주식)

(단위 : 연환산, %)

구분	해당 펀드		상위펀드 비용 합산	
	총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율	합성 총보수,비용비율	매매,중개수수료 비율
전기	1.60	0.00	1.62	0.57
당기	1.60	0.00	1.61	0.54

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
80,111	2,934,127,270	88,821	2,724,561,475	57.96	232.48

※ 매매회전율이란 해당 운용기간 중 매도한 주식이액의 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 : %)

2011-07-20 ~ 2011-10-19	2011-04-20 ~ 2011-07-19	2011-01-20 ~ 2011-04-19
57.96	111.12	125.84