

투자자를 위한 자산운용 보고서

운영기간 2023 03 30 - 2023 06 29

Professionalism

Distinctiveness

1 ()

Management

Competitiveness

Transparency

가 []
1 () []
() []



1.

2.

3.

4.

5.

6.

7. ()

가

8.

9.

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보

적용법률:	자본시장과 금융투자업에 관한 법률	위험등급	5등급(낮은위험)
-------	--------------------	------	-----------

펀드명칭		금융투자협회 펀드코드	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합)		AT124	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A		DF379	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A-e		DF380	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C		DF381	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-e		DF382	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-i		DF383	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금저축)		DF397	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)		DF398	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)		DF399	
고난도 펀드	해당없음	최초설정일	2014.06.30
운용기간	2023.03.30 - 2023.06.29	존속기간	종료일이 따로 없습니다.
펀드의 종류	투자신탁, 증권펀드(혼합채권형), 추가형, 개방형, 종류형		
자산운용회사	플러스자산운용	판매회사	KB증권, NH투자증권, IBK투자증권 외 3개
펀드재산보관회사 (신탁업자)	농협은행	일반사무관리회사	신한펀드파트너스
상품의 특징			
이 투자신탁은 채권을 자본시장과 금융투자업에 관한 법률 시행령 제94조 제2항 제4호에서 규정하는 주된 투자대상자산으로 하여 수익을 추구하는 것을 목적으로 합니다. 또한, 자산총액의 30% 미만을 국내주식(공모주 포함)에 투자하여 자본이득을 추구합니다.			

주) 펀드의 자세한 판매회사는 금융투자협회 홈페이지 [<http://dis.kofia.or.kr>],
 운용사 홈페이지 [<http://www.plusasset.com>] 에서 확인하실 수 있습니다.

▶ 자산현황

(단위: 백만원, %)

※ 아래 표를 통하여 당기말과 전기말 간의 자산총액, 부채총액, 순자산총액 및 기준가격의 추이를 비교하실 수 있습니다.

펀드명칭	항목	전 기 말	당 기 말	증감률
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합)	자산총액	16,661	16,322	-2.03
	부채총액	0	6	6239.69
	순자산총액	16,660	16,316	-2.07
	기준가격	1,165.93	1,179.45	1.16
종류(Class)별 기준가격 현황				
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A	기준가격	1,095.06	1,104.99	0.91
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A-e	기준가격	1,049.53	1,059.93	0.99
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C	기준가격	1,128.96	1,137.76	0.78
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-e	기준가격	1,057.64	1,067.23	0.91

플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-i	기준가격	1,097.18	1,107.40	0.93
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금지속)	기준가격	1,048.39	1,058.43	0.96
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)	기준가격	1,042.68	1,051.92	0.89
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)	기준가격	1,048.60	1,058.66	0.96

주) 기준가격이란 투자자가 펀드를 입금(매입), 출금(환매)하는 경우 또는 분배금(상환금포함) 수령시에 적용되는 가격으로 펀드의 순자산총액을 발행된 수익증권 총좌수로 나눈 가격을 말합니다.

※분배금내역

(단위: 백만원, 백만좌)

분배금 지급일	분배금 지급금액	분배후 수탁고	기준가격(원)		비고
			분배금 지급전	분배금 지급후	
2023.06.30	329	13,834	1,179.45	1,155.66	

▶ 펀드의 투자전략

1. 공모주
철저한 기업분석과 합리적인 수요예측을 통한 선별적 투자
IPO시장 동향 및 신규상장 종목에 대한 예비 투자자 선호도 파악
2. 모멘텀 트레이딩
매크로 및 기술적 환경에 따른 모멘텀 트레이딩 ‘알파헌터’ 전략
시장 주도주의 단기 진입 후 알파수익 확보 시 포지션 청산
3. 채권 운용
국고채, 통안채 및 은행채 등 투자
적정 듀레이션 관리를 통한 유동성 및 수익성 추구
금리 선물을 활용하여 듀레이션 조절 및 추가 수익 추구

2. 운용경과 및 수익률 현황

▶ 운용경과

당사는 운용기간 동안 총 10개의 공모주 수요예측에 참여하였습니다. 해당 분기에 랍업이 해제된 종목을 포함한 총 5개의 종목에서 수익을 실현하였습니다. 주요 수익 기여 상위 5개 종목은 시큐션, 진영, 모니터랩, 트루엔, 에스바이오메딕스이며 해당종목에서 전체 수익의 87.8%가 발생하였습니다.

23년 2분기 주식시장은 물가지표가 시장의 예상대로 우하향 하고 미 연준의 금리 인하 가능성도 낮아진 가운데 지수의 큰 변동 없이 종목장세 양상을 보이며 운용기간동안 코스피는 3.5%, 코스닥은 2.4% 상승하였습니다. 1분기 미 지방은행 위기 사태로 촉발된 금리 인하 기대감이 위기가 안정되자 사라져 갔습니다. 다만 물가가 안정적인 경로로 우하향하고 미국 경기도 서비스업 위주로 견조함을 보이며 주식시장에 타격을 줄만한 큰 매크로 리스크가 부재하였고 지수의 변동성이 제한된 가운데 개별 종목들의 강세가 이어지는 종목장세 양상을 보였습니다. 2분기는 전반적인 주식시장의 흐름이 금융장세에서 경기기대감을 반영하는 실적장세로 전환되는 분기점으로 판단하고 있고 이에 걸맞는 산업채 종목들이 시장을 주도하였습니다.

2분기 시장에서 주목 받았던 종목들과 섹터를 보면 1분기 실적 성장이 부각된 종목들의 상대적인 수익률 상승이 컸습니다. 산업의 성장성이 지속되고 있는 엔터섹터와 중소형 화장품 종목들이 어닝서프라이즈를 보여주면서 크게 상승하였는데 산업의 구조적 변화와 인플레이션 대응에 따른 가격인상이 실적개선에 반응하면서 추가에 즉시 반영되었습니다. 이러한 실적성장이 지속되고 있는 퀄리티 기업들의 양호 흐름들이 연중내내 이어질 가능성이 높다고 판단하고 있습니다.

해당 기간 국내 채권시장은 3월 초 미국 SVB 은행 파산과 CS 유동성 문제가 불거지며 레벨 빠르게 하락하였습니다. 이에 연내 인하 기대감까지 확대되며 국내 3-10Y 레벨은 3.2% 수준까지 하락하였습니다. 이후 미국시장은 주요 지표들을 확인하면서 등락을 이어간 뒤 6월 초 미국 부채한도 협상 Due-date을 앞두고 난항을 겪으며 단기물 약세를 나타냈으며, 기대인플레이션 상승으로 인해 장기물도 약세 나타내는 모습이었습니다. 반면 국내는 CPI가 3% 대로 낮아지는 흐름을 보이는 등 채권시장은 일정한 범위 안에서 등락을 거듭하였습니다. 다만 5월 수정경제전망에서 올해 Core-CPI를 0.3%p 높은 3.3%로 제시하며 다소 부담 확대되었고, 미국의 올해 점도표 인상 등으로 인해 조금씩 약세 흐름 보였습니다. 이에 해당 펀드에서는 상대적으로 짧은 만기 국내 및 통안채 위주 안정적 운용 하였습니다.

▶ 투자환경 및 운용계획

하반기 주요 상장 유망 종목은 KOSPI시장에서 에코프로머티리얼즈, 두산로보틱스, 서울보증보험이며 KOSDAQ 시장에서는 파두, 신성에스티, 밀리의 서재입니다. 22년 고밸류로 공모시장에 참여하지 못했던 기업들이 시장안정화와 밸류에이션 합리화로 공모시장을 하반기부터 적극적으로 참여할 것으로 전망합니다. 이에 대비하여 적극적인 공모 기업 분석과 수요예측 참여로 공모주투자 수익 개선에 집중할 것입니다.

알파전략과 관련한 유동 주식시장 관련하여 3분기는 큰 매크로 이벤트가 없는가운데 2분기 실적이 발표되면서 하반기와 24년에 대한 실적 전망이 점차 시장에 반영되는 시점입니다. 현재 24년 코스피 추정 순이익은 약 200조로 컨센서스가 형성되어 있으며 이는 23년대비 약 70조의 이익개선이 필요한 큰 폭의 상승입니다. 24년 경기확장에 따른 국내기업 이익 성장을 기대하고 있지만 24년 이익 규모는 다소 과도한 숫자라고 판단하고 있습니다. 시장의 기대치와 현실의 간극이 크게 벌어져 있다는건 현재 주식시장이 과도한 기대치를 반영했거나 혹은 실제 이익전망이 과소평가되어 있는것으로 시장과 기대치가 상호간의 간극을 좁히는 과정이 나오면서 시장의 변동성이 하반기중 발생할 가능성이 높다고 판단합니다. 하지만 어떤 상황이든 경기가 확장되는 방향성을 타기 때문에 주식시장은 우상향할 가능성이 높다고 생각합니다. 이러한 기조에 따라 하반기까지 적극적으로 주식알파전략을 시행하여 전체 펀드 수익률 개선에 집중할 것입니다.

추후 대외 주요국 금리는 추가 인상기조 이어갈 가능성이 있어 국내 역시 대외금리에 다소 연동되는 흐름 보여질 것으로 판단됩니다. 미국의 경우 올해 점도표 중간값을 50bp 인상하였으며, 호주와 캐나다 등 주요국들 역시 재차 금리 인상기조 이어가는 상황입니다. 다만 국내는 Core CPI가 다소 높으나 주요국들 대비 절대적으로 낮은 수준이고, Headline CPI의 경우 기저효과로 인해 2% 대 까지 하락할 것 예상되는 상황에서 추가 금리 인상 가능성은 낮다고 판단됩니다. 국채금리의 경우 대외금리 베어플렛 장세에 연동되어 현 수준보다는 약세 우려가 있다고 판단됩니다. 이에 해당 펀드에서는 국채 및 통안채 위주 안정적으로 운용 할 계획입니다.

▶ 기간수익률

(단위: %)

펀드명칭	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근12개월	최근2년	최근3년	최근5년
	23.03.30 ~ 23.06.29	22.12.30 ~ 23.06.29	22.09.30 ~ 23.06.29	22.06.30 ~ 23.06.29	21.06.30 ~ 23.06.29	20.06.30 ~ 23.06.29	18.06.30 ~ 23.06.29
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호 (채권혼합)	1.16	2.40	3.15	3.80	6.80	14.73	11.35
(비교지수대비 성과)	(0.59)	(-0.25)	(-1.10)	(0.15)	(5.48)	(4.07)	(-2.05)
비 교 지 수	0.57	2.65	4.25	3.65	1.32	10.66	13.40
종류(Class)별 현황							
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호 (채권혼합) 종류 A	0.91	1.90	2.39	2.78	4.69	-	-
(비교지수대비 성과)	(-0.26)	(-2.52)	(-3.94)	(-1.58)	(7.25)	-	-
비 교 지 수	1.17	4.42	6.33	4.36	-2.56	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호 (채권혼합) 종류 A-e	0.99	2.05	2.61	3.06	5.25	-	-
(비교지수대비 성과)	(0.42)	(-0.60)	(-1.64)	(-0.59)	(3.93)	-	-
비 교 지 수	0.57	2.65	4.25	3.65	1.32	-	-

플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호 (채권혼합) 종류 C	0.78	1.65	2.01	2.27	3.66	10.68	7.41
(비교지수대비 성과)	(0.21)	(-1.00)	(-2.24)	(-1.38)	(2.34)	(0.02)	(-5.99)
비 교 지 수	0.57	2.65	4.25	3.65	1.32	10.66	13.40
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호 (채권혼합) 종류 C-e	0.91	1.90	2.39	2.78	4.69	-	-
(비교지수대비 성과)	(0.34)	(-0.75)	(-1.86)	(-0.87)	(3.37)	-	-
비 교 지 수	0.57	2.65	4.25	3.65	1.32	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호 (채권혼합) 종류 C-i	0.93	1.95	2.47	2.88	4.90	-	-
(비교지수대비 성과)	(-0.24)	(-2.47)	(-3.86)	(-1.48)	(7.46)	-	-
비 교 지 수	1.17	4.42	6.33	4.36	-2.56	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금저축)	0.96	2.00	2.54	2.98	5.11	-	-
(비교지수대비 성과)	(0.39)	(-0.65)	(-1.71)	(-0.67)	(3.79)	-	-
비 교 지 수	0.57	2.65	4.25	3.65	1.32	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)	0.89	1.86	2.33	2.70	4.53	-	-
(비교지수대비 성과)	(0.32)	(-0.79)	(-1.92)	(-0.95)	(3.21)	-	-
비 교 지 수	0.57	2.65	4.25	3.65	1.32	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)	0.96	2.00	2.55	2.99	5.13	-	-
(비교지수대비 성과)	(0.39)	(-0.65)	(-1.70)	(-0.66)	(3.81)	-	-
비 교 지 수	0.57	2.65	4.25	3.65	1.32	-	-

※ 비교지수 : (0.05 * [KOSPI]) + (0.95 * [KIS국고채 01-02Y])

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

▶ 추적오차

(단위: %)

※ 해당사항 없음

▶ 손익현황

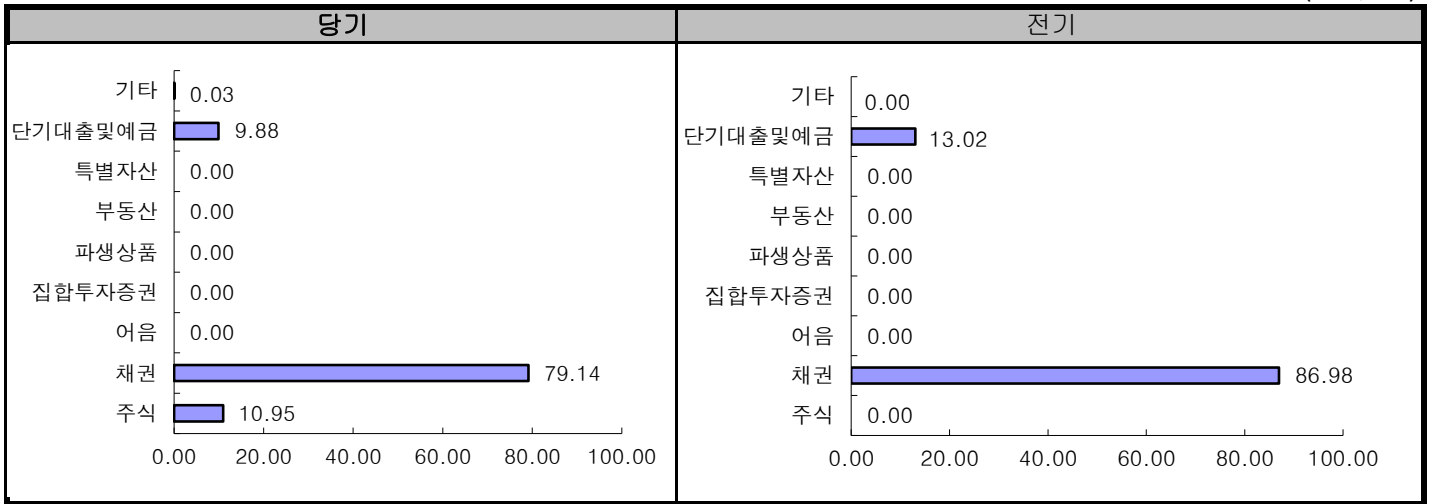
(단위: 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합 투자증권	장내	장외		실물 자산	기타			
전기	63	116	-	-	-	-	-	-	-	30	0	208
당기	63	109	-	-	-	-	-	-	-	17	0	189

3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: %)



[자산구성현황]

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합 투자 증권	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	1,787 (10.95)	12,918 (79.14)	-	-	-	-	-	-	-	1,613 (9.88)	5 (0.03)	16,322 (100.00)
합계	1,787 (10.95)	12,918 (79.14)	-	-	-	-	-	-	-	1,613 (9.88)	5 (0.03)	16,322 (100.00)

* () : 구성 비중

▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지란?	※ 해당사항 없음
펀드수익률에 미치는 효과	※ 해당사항 없음

(단위: %, 원)

투자설명서상의 목표 환헤지 비율	기준일(2023.06.29) 현재 환헤지 비율	(2023.03.30 ~ 2023.06.29) 환헤지 비용	(2023.03.30 ~ 2023.06.29) 환헤지로 인한 손익
-	-	-	-

주) 환헤지란 환율 변동으로 인한 외화표시자산의 가치변동위험을 선물환계약 등을 이용하여 줄이는 것을 말하며, 환헤지 비율은 기준일 현재 펀드에서 보유하고 있는 총 외화자산의 평가액 대비, 환헤지 규모를 비율로 표시한 것을 말합니다.

▶ 환헤지를 위한 파생상품

※ 해당사항 없음

▶ 주요자산보유현황

※ 펀드자산 총액에서 상위 10종목, 자산총액의(파생상품의 경우 위험평가액) 5% 초과 보유종목 및 발행주식 총수의 1% 초과 종목의 보유내역을 보여줍니다.

※ 보다 상세한 투자대상자산 내역은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하십시오.

수 있습니다. (인터넷 주소 : <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및
 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ **주식 - Long(매수)**

(단위: 주, 백만원, %)

종 목 명	보유수량	평가액	비중	비고
심택	10,305	353	2.17	-
삼성전자	4,597	333	2.04	-
메리츠금융지주	7,593	315	1.93	-
한국콜마	4,017	176	1.08	-
OCI홀딩스	1,400	156	0.96	-
삼성전기	1,080	155	0.95	-
와이저엔터테인먼트	1,954	153	0.94	-
YG PLUS	10,000	65	0.40	-

▶ **주식 - Short(매도)**

※해당사항 없음

▶ **채권**

(단위: 백만원, %)

종 목 명	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중	비고
통안DC023-0904-0910	13,000	12,918	2023.06.05	2023.09.04	-	RF	79.14	79.14

▶ **어음**

※해당사항 없음

▶ **집합투자증권**

※해당사항 없음

▶ **장내파생상품**

※해당사항 없음

▶ **장외파생상품**

※해당사항 없음

▶ **부동산(임대)**

※해당사항 없음

▶ **부동산 - 자금대여/차입**

※해당사항 없음

▶ **특별자산**

※해당사항 없음

▶ **단기대출 및 예금**

(단위: 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	비고
예금	농협은행		1,613	2.99		자산 5%초과 (9.88)

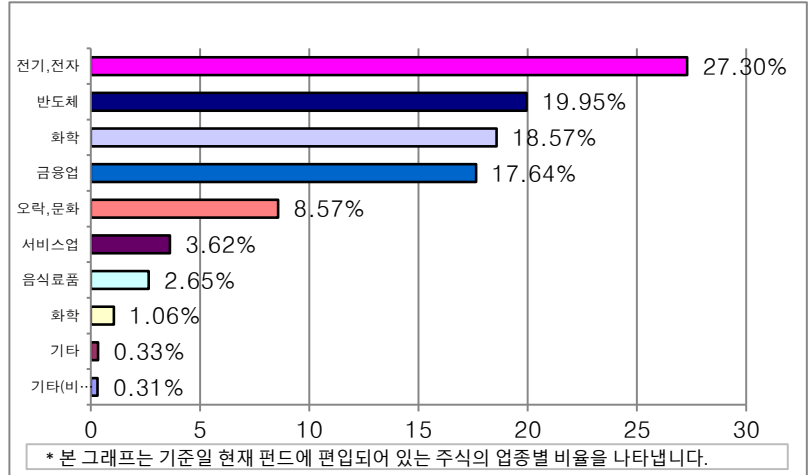
▶ **기타자산**

※해당사항 없음

▶ **업종별(국내주식) 투자비중 - Long(매수)**

(단위: 백만원, %)

	업종명	평가액	보유비율
1	전기, 전자	488	27.30
2	반도체	356	19.95
3	화학	332	18.57
4	금융업	315	17.64
5	오락, 문화	153	8.57
6	서비스업	65	3.62
7	음식료품	47	2.65
8	화학	19	1.06
9	기타	6	0.33
10	기타(비분류)	6	0.31
11			
합 계		1,787	100.00



주) 보유비율=평가액/총평가액*100

주) 업종기준은 코스콤 기준

▶ **업종별(국내주식) 투자비중 - Short(매도)**

※ 해당사항 없음

▶ **업종별(해외주식) 투자비중**

※ 해당사항 없음

▶ **국가별 투자비중**

발행(상장)국가별 투자비중

* 일부 해외종목의 경우 거래소 상장국가와 실제 발행국가가 상이할 수 있습니다.

※ 해당사항 없음

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위: 개, 억원)

성명	운용개시일	직위	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		주요 경력 및 운용내역	협회등록번호
			펀드 개수	운용 규모	개수	운용 규모		
경우현	2018.11.02	책임운용전문인력	13	970	1	184	한국외국어대학교 경제학졸업	2109001273
							2003.12~2005.03 대신증권 지점영업	
							2005.04~2016.03 대신자산 운용 주식운용본부 팀장	
							2016.05~현재 플러스자산 운용 주식운용본부장	
이관홍	2014.06.30	운용전문인력	1	740	1	2,297	한양대학교 경영학과	2109000403
							1993.08~1999.05 대한투자신탁 채권운용	
							1999.06~2000.06 중앙종합금융 수석펀드매니저	
							2000.07~2003.07 새마을금고연합회 채권운용	
							2004.01~2005.11 굿앤리치 자산운용	
							2006.01~현재 플러스자산 운용 채권운용본부장	

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임운용전문인력이며, 책임운용전문인력이란 운용전문인력중 투자전략 수립 및 투자 의사 결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말합니다.

※ 펀드의 운용전문인력 변경내역 등은 금융투자협회 전자공시사이트의 수시공시 등을 참고하실 수 있습니다. (인터넷 주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트가 제공하는 정보와 본 자산운용보고서가 제공하는 정보의 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▶ 운용전문인력 변경내역

기 간	운용전문인력
2014.06.30 - 2023.06.29	이관홍
2018.11.02 - 2023.06.29	경우현

주) 2023.06월 기준 최근 3년간의 운용전문인력 변경 내역입니다.

▶ 해외 투자운용전문인력

※ 해당사항 없음

▶ 해외 위탁운용

※ 해당사항 없음

5. 비용현황

▶ 보수 및 비용 지급현황

(단위: 백만원, %)

펀드 명칭	구 분	전 기		당 기		
		금액	비율(%)*	금액	비율(%)*	
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호 (채권혼합)	자산운용회사	19.39	0.11	18.97	0.12	
	판매회사	25.91	0.15	24.93	0.15	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A	0.75	0.12	0.43	0.13	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A-e	0.01	0.06	0.00	0.06	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C	14.80	0.25	13.87	0.25	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-e	0.65	0.12	0.63	0.13	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-i	9.22	0.10	9.52	0.10	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금저축)	0.19	0.07	0.17	0.08	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)	0.10	0.14	0.11	0.15	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)	0.19	0.07	0.20	0.07	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.97	0.01	0.95	0.01	
	일반사무관리회사	0.63	0.00	0.62	0.00	
	보수 합계	46.90	0.27	45.47	0.28	
	기타비용**	0.29	0.00	0.29	0.00	
	매매· 중개수수료	단순매매·중개 수수료	0.61	0.00	9.63	0.06
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0.04	0.00	2.08	0.01
		합계	0.65	0.00	11.71	0.07
증권거래세	0.31	0.00	9.56	0.06		

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

** 기타비용이란 회계감사비용, 증권 등의 예약 및 결제비용 등 펀드에서 경상적·반복적으로 지출된 비용으로서 매매·중개 수수료는 제외한 것입니다.

※ 성과보수내역 : 해당사항 없음

▶ 총보수비용 비율

(단위: 연환산, %)

펀드 명칭	구분	해당 펀드			상위펀드 비용 합산		
		총보수·비용 비율(A)	매매·중개수 수수료비율(B)	합계(A+B)	총보수·비용 비율(A)	매매·중개수 수수료비율(B)	합계(A+B)
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합)	전기	0.01	0.02	0.02	0.01	0.02	0.02
	당기	0.01	0.28	0.29	0.01	0.28	0.29
종류(class)별 현황							
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A	전기	1.00	-	1.00	1.01	0.02	1.02
	당기	1.00	-	1.00	1.01	0.25	1.25
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A-e	전기	0.74	-	0.74	0.74	0.02	0.76
	당기	0.72	-	0.72	0.73	0.06	0.79
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C	전기	1.50	-	1.50	1.51	0.02	1.52
	당기	1.50	-	1.50	1.51	0.29	1.79

플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-e	전기	1.00	-	1.00	1.01	0.02	1.02
	당기	1.00	-	1.00	1.01	0.28	1.29
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-i	전기	0.90	-	0.90	0.91	0.02	0.92
	당기	0.90	-	0.90	0.91	0.29	1.19
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금저축)	전기	0.80	-	0.80	0.80	0.02	0.82
	당기	0.80	-	0.80	0.81	0.26	1.06
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)	전기	1.08	-	1.08	1.08	0.02	1.10
	당기	1.08	-	1.08	1.08	0.29	1.37
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)	전기	0.79	-	0.79	0.80	0.02	0.81
	당기	0.79	-	0.79	0.80	0.28	1.08

- 주1) 총보수, 비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수와 기타비용총액을 순자산 연평잔액(보수·비용 차감후 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 총보수·비용수준을 나타냅니다.
- 주2) 매매·중개수수료 비율이란 매매·중개수수료를 순자산 연평잔액(보수·비용 차감후 기준)으로 나눈 비율로서 해당 운용기간 중 투자자가 부담한 매매·중개수수료의 수준을 나타냅니다.
- 주3) 모자형의 경우 모펀드에서 발생한 비용을 자펀드가 차지하는 비율대로 안분하여 합산한 수치입니다.

6. 투자자산매매내역

▶ 매매주식규모 및 회전을

(단위: 주, 백만원, %)

플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합)

매 수		매 도		매매회전율 ^(주1)	
수 량	금 액	수 량	금 액	해당기간	연환산
147,226	6,487	104,812	4,782	282.82	1,122.06

주1) 해당운용기간 중 매도한 주식가액의 총액을 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ 최근3분기 매매회전을 추이

(단위: %)

2022.06.30 ~ 2022.09.29	2022.09.30 ~ 2022.12.29	2022.12.30 ~ 2023.03.29
99.11	251.41	994.74

주) 매매회전율이 높을 경우 매매거래수수료 및 증권거래세 발생으로 실제 투자자가 부담하게 되는 펀드 비용이 증가합니다.

7. 동일한(해당) 집합투자업자가 운용하는 집합투자기구에 대한 투자현황

※해당사항 없음

8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

<p>① 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등</p> <p>국내주식(30%미만)과 국내채권(90%이하)에 투자하고 중위험·중수익률을 추구하는 채권혼합형 펀드임. 일반적으로 주식형펀드의 기준가보다는 변동성이 작고 채권형펀드의 기준가보다는 변동성이 큰 특성을 보임. 공모주 투자와 주식시장 주도주 투자를 통한 알파헌터 전략을 실행하고 있음. 공모주의 성과가 부진하거나 주식시장의 성과가 부진할 경우, 손실이 발생할 위험이 있음.</p> <p>② 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등</p> <p>해당사항 없음.</p>

▶ 주요 위험 관리 방안

<p>① 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등</p> <p>주식 유동성 리스크관리를 위해 거래량(30%) 초과매매 여부, 일별 매수거래관여율(30%) 여부, 누적매수수량이 종목 상장주식수의 5%초과 여부, 당일 매수 수량이 상장주식수의 1% 여부 등을 매일 점검함. 주식 투자유니버스 제외종목(3년연속적자, 투자유의종목 등)들에 대하여 운용을 제한하고 있음. 주식 손절대상종목(손실을 30%이상 이고 벤치마크대비 15%이상 언더퍼폼)들을 점검하여 투자위험을 줄이고 있음.</p> <p>② 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한·수단 등</p> <p>재간접 펀드에 대한 운용은 타사 펀드의 경우 운용을 제한하고 있음. 타사 펀드에 투자할 경우에는 위험관리(운용보고서 수령 및 운용정보의 주요 항목 요청등)에 대하여 추가적으로 검토하여 조치할 계획임.</p> <p>③ 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등</p> <p>환매중단, 상환연기, 부실자산 등 위험이 발생하거나 발생 가능성이 높다고 판단될 때에는 법률과 당사 리스크 관리 규정에 따라 대표이사에게 보고하고 리스크관리위원회와 집합투자평가위원회를 개최하여 고객의 이익을 위해 선관주의의무를 충실히 실행할 것임.</p>
--

▶ 자전거래 현황

※해당사항 없음

▶ 자전거래 사유, 이해상충 등 방지를 위해 실시한 방안, 절차

※해당사항 없음

▶ 주요 비상대응계획

위기 상황 단계 별 대응 조치 정상 단계, 주의단계, 위험단계 로 나눔 정상 단계: 월별, 수시 검사결과 특이사항 미발생시, 대표이사 월별현황 보고 주의 단계: 월별, 수시 검사결과 특이사항 발생시, 원익파악 및 대표이사 보고, 관계자에 대한 주의통보 여부 결정 위험 단계: 월별, 수시 검사결과 중대한 사항 발생시, 리스크관리위원회 보고 후 대응방안 결정, 관계자에 서면 통보 및 징계여부 결정

9. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

(단위: 백만원, %)

펀드명	분류	투자일	투자금	회수일	회수금	투자잔액	수익률
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁 1호 (채권혼합) c-i	추가 투자	2021-06-22	200	-	-	200	4.77

■ 수익률은 [기준일 잔고의 평가금액/기준일 잔고의 취득액-1]*100%을 통해 산출된 값입니다.