

투자자를 위한 자산운용 보고서

운영기간 2023 06 30 - 2023 09 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	2023.06.30 - 2023.09.29	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
펀드의 종류	투자신탁, 증권펀드(혼합채권형), 추가형, 개방형, 종류형		
자산운용회사	플러스자산운용	판매회사	KB증권(구 현대), 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.

▶ **재산현황**

(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	16,322	16,495	1.06
	부채총액	335	4	-98.78
	순자산총액	15,987	16,491	3.15
	기준가격	1,155.66	1,183.03	2.37
종류(Class)별 기준가격 현황				
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A	기준가격	1,104.91	1,128.26	2.11
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A-e	기준가격	1,059.85	1,083.13	2.20
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C	기준가격	1,137.68	1,160.27	1.99
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-e	기준가격	1,067.16	1,089.71	2.11
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-i	기준가격	1,107.32	1,131.00	2.14
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁 1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금저축)	기준가격	1,058.20	1,081.10	2.16
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁 1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)	기준가격	1,051.84	1,073.86	2.09
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁 1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)	기준가격	1,056.56	1,079.46	2.17

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)

※ 해당사항 없음

▶ **펀드의 투자전략**

<p>1. 공모주 철저한 기업분석과 합리적인 수요예측을 통한 선별적 투자 IPO시장 동향 및 신규상장 종목에 대한 예비 투자자 선호도 파악</p> <p>2. 모멘텀 트레이딩 매크로 및 기술적 환경에 따른 모멘텀 트레이딩 ‘알파헌터’ 전략 시장 주도주의 단기 진입 후 알파수익 확보 시 포지션 청산</p> <p>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</p>
--

2. 운용경과 및 수익률 현황

▶ 운용경과

(채권부문)

해당기간 국내 채권시장은 대외 주요국 긴축기조가 재차 강화되며 단기물 위주의 금리상승인 베어플랫 장세를 나타낸 뒤, 미국채 발행량 증가 및 유가상승 등으로 베어스텝(단기금리에 비해 장기금리의 상승폭이 큰 현상) 장세가 나타나는 모습. 호주와 캐나다가 동결 이후 인상기조를 이어가는데, 미국 1분기 GDP 확정치가 연율 2%로 속보치를 상회하였고 6월 FOMC에서 올해 점도표를 추가 2회 인상하며 약세를 나타내었음. 미국 7월 소매판매지수가 전월비 0.7%로 예상치를 크게 상회한 가운데, 8월 예정되었던 잭슨홀 회의에서 중립금리 상향여부에 대한 우려 등이 섞이며 장기물이 미10Y 기준 4.3% 수준까지 상승하였음. 국내는 7월 소비자물가지수가 전년 대비 2.3% 수준까지 하락하였으며, 7월과 8월 금통위에서 현 3.5% 기준금리를 동결하였으나, 내년도 성장률을 0.1%p 하향조정한 2.2%를 제시하였고 올해 근원물가를 0.1%p 상향조정한 3.4%로 제시하였음.

해당기간 동 펀드에서는 국채 및 통안채 위주로 편입하며 안정적으로 운용하였음.

(주식부문)

당사는 운용기간 동안 총 20개의 공모주 수요예측에 참여하였고, 해당 분기에 보호예수가 해제된 종목을 포함하여 총 15개의 종목에서 수익을 실현하였음. 주요 수익기여 상위 종목은 큐리옥스바이오시스템즈, 이노시물레이션, 마너공장, 밀리의서재, 버벡트이며 해당 종목에서 전체 수익의 24.4%가 발생하였음.

2023년 3분기 주식시장은 물가지표 하향과 금리 고점에 대한 기대감으로 골디락스 장세를 보이면서 연 최고치를 경신하였으나, 긴축에 대한 우려가 커지면서 운용기간동안 코스피는 -3.9%, 코스닥은 -3.1% 하락하였음.

유가의 안정화와 작년 기고부담에 따른 물가경로 하향 및 연준의 Data Dependent 기조가 맞아들어가면서 증시가 우상향하는 흐름이 분기초 지속되었음. 하지만 금융시장 과열과 미국 경기 호조에 대한 연준의 인식이 긴축 강화로 바뀌면서 시장은 차갑게 가라앉기 시작하였음. 연초 이후 계속 상승하던 코스닥 종목들과 2차전지 종목들의 차익실현이 강하게 동반되면서 지수가 고점 이후 10% 가량 조정장세를 시현하였음.

▶ 투자환경 및 운용계획

(채권부문)

최근 사우디와 러시아가 감산계획을 연장하며 유가가 재차 90불 대를 상회하는 수준까지 상승하였음. 이에 내년도 금리인하 기대감이 일정부분 후퇴하며 긴축기조 장기화가 예상되고 있음. 9월 FOMC에서는 현 5.5% 수준에서 만장일치로 동결하였으나, 내년도 점도표 중간값을 50bp 조정하였으며 내후년 역시 50bp 상향 조정하였음. 반면 올해 성장을 전망치는 기존 1%에서 2.1%로 크게 상향 조정. FOMC 이후 긴축기조 장기화 가능성이 더욱 높아지며 이스라엘-하마스 분쟁에도 불구하고 2-10Y 역전폭이 지속적으로 축소되었고 미국 10Y의 경우 5.0%를 넘어서는 등 약세가 심화됨. 국내 역시 10Y 금리가 4.3%를 넘어서며 베어스텝(단기금리에 비해 장기금리의 상승폭이 큰 현상) 장세를 나타내는 모습. 이후 소폭 되돌림 가능성이 있으나 추세 전환까지는 지표확인이 추가적으로 필요할 것으로 판단되며 당분간 변동성 장세가 예상됨.

이에 동 펀드에서는 국채 및 통안채 위주로 편입하며 안정적으로 운용할 계획임.

(주식부문)

하반기 주요 상장 유망종목은 코스피시장에서 에코프로머티리얼즈, 서울보증보험이며 코스닥시장에서는 컨택, 에코아이, 웰리타스반도체, 에이직랜드임. 2022년 고밸류로 공모시장에 참여하지 못했던 기업들이 시정안정화와 밸류에이션 합리화로 하반기부터 공모시장에 적극적으로 참여할 것으로 전망됨. 이에 대비하여 적극적인 공모기업 분석과 수요예측 참여로 공모주투자 수익개선에 집중할 것임.

알파전략의 유통주식시장과 관련한 시장전망은 연초와 2,3분기에 걸쳐 올해를 기점으로 제조업 경기가 점진적으로 살아나고 국내 기업들의 실적이 점차 개선세에 들어설 것이라는 전망은 바뀌지 않았음. 긴축이 마무리되고 SVB뱅크런으로 인한 금융완화 이후 경기반등에 따른 실적장세 전환을 전망하고 있지만 시장은 여러 가지 이유로 의구심을 갖고 있다고 생각함. 첫 번째로는 2024년 실적 전망치에 대한 회의적인 시각임. 특히 반도체 경기가 본격적으로 개선되고 있지 않아 2024년 실적 전망치에 대한 신뢰가 낮게 형성되고 있음. 두 번째는 이미 과도하게 오른 주가 수준임. 2022년 하반기부터 근 1년간 주가가 올라왔기 때문에 추가적인 상승에 대한 확신이 약한 상황임. 이러한 이유 때문에 시장이 조정과 반등을 반복하면서 뚜렷한 방향성을 찾지 못하고 있는 상황임.

지금은 단기적인 리스크가 존재하는 상황으로 판단하지만 장기적으로, 특히 2024년까지는 주식시장이 우호적인 상황을 맞이하게 될 것이라고 생각함. 지속적으로 밝혀왔듯이 지금은 제조업 경기가 강하진 않지만 우상향하는 흐름 속에 있다는 매크로 관점을 강력하게 지지하고 있음. 뚜렷한 회복세가 보이지 않고 있는 여러 이유 중 하나는 팬데믹 기간동안 발생한 과도한 주문과 소화되지 않고 있는 재고가 반등사이클을 지연시키고 있다고 판단함. 하지만 이조차도 시간이 갈수록 재고가 소진되면서 재구축 사이클로 접어들 것으로 판단하고 있음.

수요의 약세가 우리 기업들의 실적개선 기대감을 낮게 갖게 하는 이유 중 하나이지만 대한민국은 제조업 앞단에 위치하고 있기 때문에 미세한 수요의 증감(재고구축)에도 꽤 괜찮은 기업실적 개선이라는 효과를 받을 수 있는 장점을 갖고 있음.

펀드 장기성과 개선을 위해 경쟁력 있는 기업들을 지속적으로 발굴하면서 향후 경기개선에 따른 수혜가 큰 기업들을 트레이딩하여 성과개선에 집중할 것임.

▶ 기간수익률

(단위: %)

펀드명칭	최근3개월	최근6개월	최근9개월	최근12개월	최근2년	최근3년	최근5년
	23.06.30 ~ 23.09.29	23.03.30 ~ 23.09.29	22.12.30 ~ 23.09.29	22.09.30 ~ 23.09.29	21.09.30 ~ 23.09.29	20.09.30 ~ 23.09.29	18.09.30 ~ 23.09.29
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합)	2.37	3.56	4.83	5.60	7.85	16.61	14.54
(비교지수대비 성과)	(1.83)	(2.45)	(1.63)	(0.79)	(5.82)	(7.98)	(1.30)
비 교 지 수	0.54	1.11	3.20	4.81	2.03	8.63	13.24
종류(Class)별 현황							
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A	2.11	3.04	4.05	4.55	5.72	-	-
(비교지수대비 성과)	(2.17)	(1.93)	(-0.31)	(-1.72)	(7.13)	-	-
비 교 지 수	-0.06	1.11	4.36	6.27	-1.41	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A-e	2.20	3.21	4.29	4.86	6.30	-	-
(비교지수대비 성과)	(1.66)	(2.10)	(1.09)	(0.05)	(4.27)	-	-
비 교 지 수	0.54	1.11	3.20	4.81	2.03	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C	1.99	2.78	3.66	4.03	4.68	12.06	10.08
(비교지수대비 성과)	(1.45)	(1.67)	(0.46)	(-0.78)	(2.65)	(3.43)	(-3.16)
비 교 지 수	0.54	1.11	3.20	4.81	2.03	8.63	13.24
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-e	2.11	3.04	4.05	4.55	5.72	-	-
(비교지수대비 성과)	(1.57)	(1.93)	(0.85)	(-0.26)	(3.69)	-	-
비 교 지 수	0.54	1.11	3.20	4.81	2.03	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-i	2.14	3.09	4.13	4.66	5.93	-	-
(비교지수대비 성과)	(2.20)	(1.98)	(-0.23)	(-1.61)	(7.34)	-	-
비 교 지 수	-0.06	1.11	4.36	6.27	-1.41	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금저축)	2.16	3.14	4.21	4.76	6.15	-	-
(비교지수대비 성과)	(1.62)	(2.03)	(1.01)	(-0.05)	(4.12)	-	-
비 교 지 수	0.54	1.11	3.20	4.81	2.03	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)	2.09	3.00	3.99	4.47	5.56	-	-
(비교지수대비 성과)	(1.55)	(1.89)	(0.79)	(-0.34)	(3.53)	-	-
비 교 지 수	0.54	1.11	3.20	4.81	2.03	-	-
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)	2.17	3.15	4.21	4.77	6.17	-	-
(비교지수대비 성과)	(1.63)	(2.04)	(1.01)	(-0.04)	(4.14)	-	-
비 교 지 수	0.54	1.11	3.20	4.81	2.03	-	-

※ 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

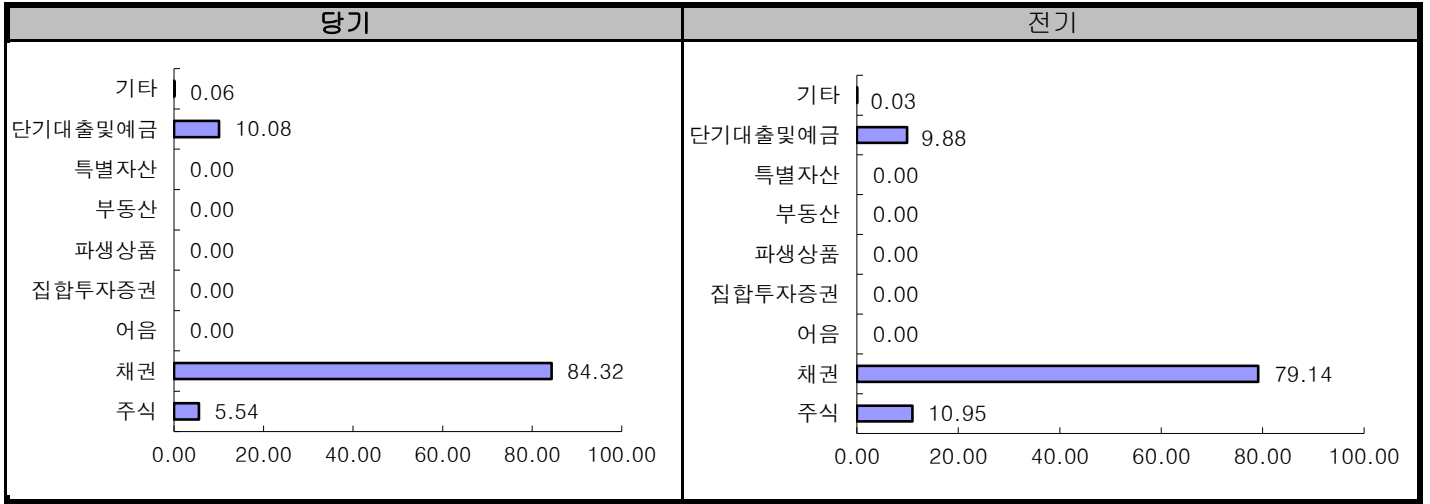
(단위: 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출 및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자 증권	장내	장외		실물 자산	기타			
전기	63	109	-	-	-	-	-	-	-	17	0	189
당기	257	126	-	-	-	-	-	-	-	15	21	419

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	914 (5.54)	13,909 (84.32)	-	-	-	-	-	-	-	1,662 (10.08)	10 (0.06)	16,495 (100.00)
합계	914 (5.54)	13,909 (84.32)	-	-	-	-	-	-	-	1,662 (10.08)	10 (0.06)	16,495 (100.00)

* () : 구성 비중

▶ 환헤지에 관한 사항

환헤지란?	※ 해당사항 없음
펀드수익률에 미치는 효과	※ 해당사항 없음

(단위: %, 원)

투자설명서상의 목표 환헤지 비율	기준일(2023.09.29) 현재 환헤지 비율	(2023.06.30 ~ 2023.09.29) 환헤지 비용	(2023.06.30 ~ 2023.09.29) 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 참고하실 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
메리츠금융지주	5,184	286	1.73	-
한국콜마	3,017	154	0.93	-
파두	2,283	81	0.49	-
두산로보틱스공모주(보)	2,972	78	0.47	-
한국금융지주	1,372	73	0.44	-
LG이노텍	250	61	0.37	-
JYP Ent.	500	56	0.34	-

▶ **주식 - Short(매도)**

※ 해당사항 없음

▶ **채권**

(단위: 백만원, %)

종 목 명	액면가액	평가금액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중	비고
통안00023-1205-0910	13,000	12,915	2023.09.05	2023.12.05	-	RF	78.30	78.3
국고채원금분리채권 03820-2312(20-8)	1,000	993	2022.04.20	2023.12.10	-	RF	6.02	6.02

▶ **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		1,662	2.99		자산 5%초과 (10.08)

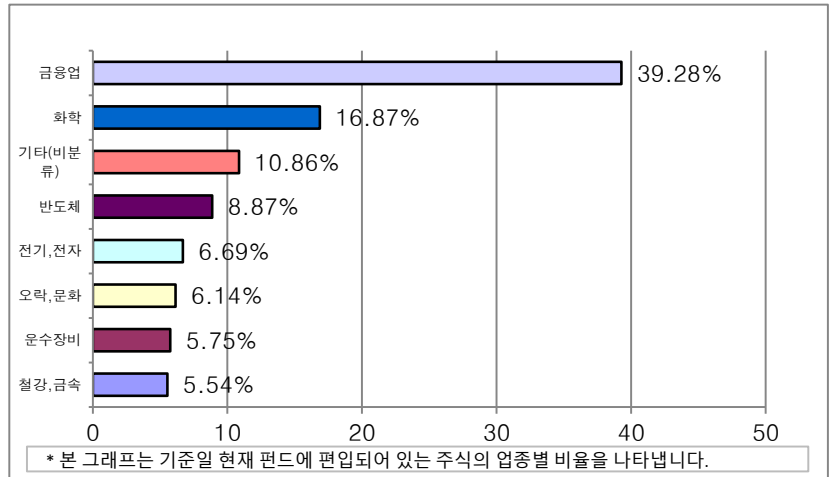
▶ 기타자산

※해당사항 없음

▶ 업종별(국내주식) 투자비중 - Long(매수)

(단위: 백만원, %)

	업종명	평가액	보유비율
1	금융업	359	39.28
2	화학	154	16.87
3	기타(비분류)	99	10.86
4	반도체	81	8.87
5	전기, 전자	61	6.69
6	오락, 문화	56	6.14
7	운수장비	53	5.75
8	철강, 금속	51	5.54
9			
10			
11			
	합 계	914	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	12	787	-	-	한국외국어대학교 경제학 졸업	2109001273
							2003.12~2005.03 대신증권 지점영업	
							2005.04~2016.03 대신자산운용 주식운용본부 팀장	
							2016.05~현재 플러스자산운용 주식운용본부장	
이관홍	2014.06.30	운용전문인력	1	770	1	2,114	한양대학교 경영학과	2109000403
							1993.08~1999.05 대한투자신탁 채권운용	
							1999.06~2000.06 중앙종합금융수석펀드매니저	
							2000.07~2003.07 새마을금고연합회 채권운용	
							2004.01~2005.11 굿앤리치자산운용	
							2006.01~ 현재 플러스자산운용 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 - 2023.09.29	이관홍
2018.11.02 - 2023.09.29	경우현

주) 2023.09월 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	18.97	0.12	20.36	0.12	
	판매회사	24.93	0.15	25.05	0.14	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A	0.43	0.13	0.36	0.13	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A-e	0.00	0.06	0.00	0.06	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C	13.87	0.25	12.04	0.25	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-e	0.63	0.13	0.59	0.13	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-i	9.52	0.10	11.65	0.10	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금저축)	0.17	0.08	0.13	0.08	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)	0.11	0.15	0.11	0.15	
	플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)	0.20	0.07	0.17	0.07	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0.95	0.01	1.02	0.01	
	일반사무관리회사	0.62	0.00	0.66	0.00	
	보수 합계	45.47	0.28	47.09	0.27	
	기타비용**	0.29	0.00	0.31	0.00	
	매매· 중개수수 료	단순매매·중개 수수료	9.63	0.06	10.17	0.06
		조사분석업무 등 서비스 수수료	2.08	0.01	1.76	0.01
		합계	11.71	0.07	11.93	0.07
	증권거래세	9.56	0.06	10.91	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·중개수수료비율(B)	합계(A+B)	총보수·비용 비율(A)	매매·중개수수료비율(B)	합계(A+B)
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합)	전기	0.01	0.28	0.29	0.01	0.28	0.29
	당기	0.01	0.27	0.28	0.01	0.27	0.28
종류(class)별 현황							
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A	전기	1.00	-	1.00	1.01	0.25	1.25
	당기	1.00	-	1.00	1.01	0.27	1.28
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 A-e	전기	0.72	-	0.72	0.73	0.06	0.79
	당기	0.71	-	0.71	0.72	0.21	0.93
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C	전기	1.50	-	1.50	1.51	0.29	1.79
	당기	1.50	-	1.50	1.51	0.27	1.78
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-e	전기	1.00	-	1.00	1.01	0.28	1.29
	당기	1.00	-	1.00	1.01	0.27	1.28
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-i	전기	0.90	-	0.90	0.91	0.29	1.19
	당기	0.90	-	0.90	0.91	0.27	1.17
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p1e(연금저축)	전기	0.80	-	0.80	0.81	0.26	1.06
	당기	0.80	-	0.80	0.80	0.27	1.07
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2(퇴직연금)	전기	1.08	-	1.08	1.08	0.29	1.37
	당기	1.08	-	1.08	1.08	0.27	1.35
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합) 종류 C-p2e(퇴직연금)	전기	0.79	-	0.79	0.80	0.28	1.08
	당기	0.79	-	0.79	0.80	0.27	1.06

- 주1) 총보수, 비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수와 기타비용총액'을 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
116,800	4,306	139,911	5,458	367.49	1,457.97

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

▶ 최근3분기 매매회전율 추이

(단위: %)

2022.09.30 ~ 2022.12.29	2022.12.30 ~ 2023.03.29	2023.03.30 ~ 2023.06.29
251.41	994.74	282.82

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

7. 동일한(해당) 집합투자업자가 운영하는 집합투자기구에 대한 투자현황

※ 해당사항 없음

8. 펀드 관련 유동성 위험 등 주요 위험현황 및 관리방안

▶ 유동성위험 등 운용관련 주요 위험 현황

① 운용전략 특성에 따른 잠재 위험요인 등

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.

② 환매중단 등 위험발생사유 또는 위험발생가능성 판단사유 등

해당사항 없음.

▶ 주요 위험 관리 방안

① 펀드의 위험요인을 통제하기 위해 시행하고 있는 방안 등

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 제외 종목(3년연속적자, 투자유의종목 등)들에 대하여 운용을 제한하고 있음. 주식 손절대상종목(손실을 30%이상이고 벤치마크대비 15%이상 언더퍼폼)들을 점검하여 투자위험을 줄이고 있음.

② 재간접펀드 등 위험관리조치 내역 및 운용사의 통제권한·수단 등

재간접 펀드에 대한 운용은 타사 펀드의 경우 운용을 제한하고 있음. 타사 펀드에 투자할 경우에는 위험관리(운용 보고서 수령 및 운용정보의 주요 항목 요청등)에 대하여 추가적으로 검토하여 조치할 계획임.

③ 환매중단, 상환연기 등과 관련된 환매재개, 투자금상환 등의 방안 및 절차 등

환매중단, 상환연기, 부실자산 등 위험이 발생하거나 발생 가능성이 높다고 판단될 때에는 법률과 당사 리스크관리 규정에 따라 대표이사에게 보고하고 리스크관리위원회와 집합투자평가위원회를 개최하여 고객의 이익을 위해 선관주의의무를 충실히 이행할 것임.

▶ 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 서면통보 및 징계여부 결정

9. 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

(단위: 백만원, %)

펀드명	분류	투자일	투자금	회수일	회수금	투자잔액	수익률
플러스 공모주 알파헌터 증권투자신탁1호(채권혼합)	추가 투자	2021-06-22	200	-	-	214	7.06

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