

자산운용보고서

알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]

(운용기간 : 2020년02월11일 ~ 2020년05월10일)

○ 자산운용보고서는 자본시장과금융투자업에관한법률(이하 '자본시장법')에 의거 집합투자업자가 작성하며, 투자자가 가입한 상품의 특정기간(3개월) 동안의 자산운용에 대한 결과를 요약하여 제공하는 보고서입니다

알파자산운용(주)

서울특별시 영등포구 국제금융로 8길 31 9층
(전화 02-769-7600, www.alphasst.com)

목 차

- 1 펀드의 개요
 - ▶ 기본정보
 - ▶ 재산현황
- 2 운용경과 및 수익률현황
 - ▶ 운용경과
 - ▶ 투자환경 및 운용계획
 - ▶ 기간(누적)수익률
 - ▶ 손익현황
- 3 자산현황
 - ▶ 자산구성현황
 - ▶ 투자대상 상위 10종목
 - ▶ 각 자산별 보유종목 내역
- 4 투자운용전문인력 현황
 - ▶ 투자운용인력(펀드매니저)
 - ▶ 해외 운용 수탁회사
- 5 비용현황
 - ▶ 업자별 보수 지급현황
 - ▶ 총보수비용 비율
- 6 투자자산매매내역
 - ▶ 매매주식규모 및 회전을
 - ▶ 최근 3분기 매매회전을 추이

1. 펀드의 개요

▶ 기본정보 자본시장과 금융투자업에 관한 법률

펀드 명칭		투자위험등급	금융투자협회 펀드코드
알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합] 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-A 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-A-E 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-C-E 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-C1 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-C2 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-C3 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-C4 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-P 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-P-E 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-S 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]Class-C-P		5등급	A5710 A5711 BM386 A5716 A5712 AE123 A5714 A5715 BF467 CG945 AP067 BF395
펀드의 종류	혼합주식형, 추가형, 종류형	최초설정일	2011.11.11
운용기간	2020.02.11 ~ 2020.05.10	존속기간	추가형으로 별도의 존속기간이 없음
자산운용회사	알파자산운용(주)	펀드재산보관회사	한국증권금융
판매회사	NH농협은행, NH투자증권, 교보증권, 대신증권, 신영증권, 우리은행, 유안타증권, 이베스트투자증권, 키움증권, 하나금융투자, 하나은행, 한국투자증권, 한국포스증권, 한화투자증권	일반사무관리회사	하나펀드서비스
상품의 특징	■ 주요 투자대상 1. 주식에의 투자 : 투자신탁 자산총액의 90% 이하 (공모주를 제외한 주식은 20% 이하) 2. 채권에의 투자 : 투자신탁 자산총액의 50% 미만 (회사채 신용등급 A-이상) 3. 어음에의 투자 : 투자신탁 자산총액의 40% 이하 4. 자산유동화증권에의 투자 : 투자신탁 자산총액의 40% 이하 ■ 주요 투자전략 - 주식 투자 : 적극적인 공모주 투자 + 제한적인 ETF (상장주식 포함) 투자 - 채권 투자 : 국공채, 금융채, 회사채, CP 투자		

▶ 재산현황

(단위: 백만원, 백만좌, %)

펀드명칭	항목	전기말	당기말	증감률
알파시나브로공모주1호[주식혼합]	자산 총액 (A)	20,153	13,896	-31.05
	부채 총액 (B)	53	0	-99.35
	순자산총액 (C=A-B)	20,100	13,896	-30.87
	발행 수익증권 총 수 (D)	20,340	13,865	-31.83
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	988.21	1,002.18	1.41
종류(Class)별 기준가격 현황				
Class-A	기준가격	985.84	997.51	1.18
Class-A-E	기준가격	986.38	998.58	1.24
Class-C-E	기준가격	985.46	996.78	1.15
Class-C1	기준가격	984.60	995.08	1.06
Class-C2	기준가격	985.09	996.05	1.11
Class-C3	기준가격	985.59	997.02	1.16
Class-C4	기준가격	986.08	998.01	1.21
Class-P	기준가격	986.09	998.01	1.21
Class-P-E	기준가격	986.29	998.40	1.23
Class-S	기준가격	986.35	998.52	1.23
ClassC-P	기준가격	985.84	997.52	1.18

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

2. 운용경과 및 수익률현황

▶ 운용경과

[주식]

- 일반 IPO는 해당기간 동안 총 7건의 수요예측 중 4건의 종목을 배정받음.
일반 IPO 공모주 시장은 지난 분기대비 종목 수가 감소하였음.
SPAC IPO는 해당기간 동안 총 3건의 수요예측 중 1건을 참여하였고 1건의 종목을 배정받음.
- 동기간동안 수요예측 기관 경쟁률은 평균 713 : 1 수준으로 지난 분기보다 상승하였으며,
제이앤티씨, 서울바이오시스, 플레이디 등 3종목이 평균을 상회하는 높은 경쟁률을 보임.
- 상장일 증가 기준으로 평균수익률은 10.41% 수준으로 지난 분기 대비 하락하였으며,
평균수익률을 상회한 종목은 서울바이오시스(배정), 레몬(미배정)으로 총 2개 종목이 있었음.
한편, 상장일 증가가 공모가를 하회한 종목은 제이앤티씨(배정), 엔피디(미배정)으로 총 2개 종목이 있었음.
- 동펀드에 수익률 기여도가 높은 업종은 온라인광고대행업 등이 있었음.

[채권]

- 2월 채권시장은 예상치 못한 코로나19 확산에 따라 안전자산 선호가 확대되며 큰 폭의 강세가 나왔음. 2월 금통위에서는 금리 동결 결정을 하였으나, 미국 증시 등 위험자산 선호가 크게 위축되자 안전자산으로의 자금 이동이 발생하며 금리가 급락하였음.
- 3월 채권시장은 코로나19가 미국과 유럽에 확산됨에 따라 금융시장 내 공포심리를 자극하였고, 현금 확보를 위해 대부분의 금융자산을 매도하는 현상이 나왔음. 한국은행은 기준금리를 50bp 인하하고, 무제한 RP매입을 발표하였으며 추경을 편성하고 채권시장 안정펀드를 조성하며 채권시장이 다소 안정을 찾았음.
- 4월 채권시장은 한국은행의 유동성 공급 정책과 정부의 금융안정 대책에 따라 장단기물 혼조 마감하였으며, 한국은행은 국고채 단순매입과 비둘기적 스탠스를 유지한 영향으로 단기물은 강세를 보였음. 3차 추경 또한 대부분 적자 국채로 조달될 것으로 예상되며 채권시장의 공급 부담을 확대시켰음.

▶ 투자환경 및 운용 계획

[주식]

- 국내 주식시장은 미국-중국 무역 마찰 확대 여부, 코로나 백신 관련 임상 데이터 발표, 미국과 중국 등 주요국들의 경제지표 등 변수에 따라 방향성이 결정될 것으로 보임. 글로벌 경기 재개에 대한 기대감이 지속적으로 작용하며 낙폭은 제한할 것으로 예상됨.
- 5월 이후 IPO 시장은 공모규모, 상장기업수에서 지난 분기 대비 상승할 것으로 전망됨. 코로나로 인해 상장을 연기했던 기업들과 SK바이오팜 등 대어급 공모주가 나올 가능성이 높기 때문. 또한 예비심사청구 종목들이 꾸준히 늘어남에 따라 하반기 공모주 시장은 성수기를 맞이할 가능성이 커보임.
- 당사는 고유의 분석 프로세스를 더욱 정교히 수행하여 상장 예정 종목에 대해 철저히 분석한 후 적정가격 산출결과를 바탕으로 하여 선별적으로 참여하는 전략을 유지. 종목별 비중을 분산하고 승률을 높이는 전략을 통해 수익률을 쌓아나갈 계획임.

[채권]

- 6월 이후 채권시장은 한국은행의 추가 금리 인하 여력이 약화되고, 국고채 매입 관련 스탠스가 강하지 않은 만큼 6월에는 공급 부담이 드러나며 약보합권 예상.
- 6월 초 발표될 3차 추경 규모는 약 30조원으로 예상되며, 하반기에 집중적으로 자금 집행이 이뤄지는 만큼 채권시장의 공급 부담은 계속 될 것으로 판단.
- 미국채 금리는 지난 3월 중 미 연준의 긴급 금리 인하와 유동성 공급 정책 발표 이후 하락과 상승이 제한되면서 좁은 박스권에서 등락 지속 중. 미 연준의 자산 매입규모도 줄어들고 있어 향후 미국채 금리 방향성은 한국 국고채 금리 방향에도 영향을 미치기 때문에 주목을 해야할 필요성이 있음.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]	1.41	0.22	1.28	1.16
(비교지수 대비 성과)	(3.10)	(0.91)	(-0.20)	(0.80)
종류(Class)별 현황				
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-A	1.18	-0.25	0.58	0.22
(비교지수 대비 성과)	(2.87)	(0.44)	(-0.90)	(-0.14)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-A-E	1.24	-0.14	0.73	0.43
(비교지수 대비 성과)	(2.93)	(0.55)	(-0.75)	(0.07)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C-E	1.15	-0.32	0.47	0.07
(비교지수 대비 성과)	(2.84)	(0.37)	(-1.01)	(-0.29)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C1	1.06	-0.49	0.21	-0.28
(비교지수 대비 성과)	(2.75)	(0.20)	(-1.27)	(-0.64)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C2	1.11	-0.40	0.35	-0.08
(비교지수 대비 성과)	(2.80)	(0.29)	(-1.13)	(-0.44)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C3	1.16	-0.30	0.50	0.12
(비교지수 대비 성과)	(2.85)	(0.39)	(-0.98)	(-0.24)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C4	1.21	-0.20	0.65	0.32
(비교지수 대비 성과)	(2.90)	(0.49)	(-0.83)	(-0.04)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-P	1.21	-0.20	0.65	0.32
(비교지수 대비 성과)	(2.90)	(0.49)	(-0.83)	(-0.04)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-P-E	1.23	-0.16	0.71	0.40
(비교지수 대비 성과)	(2.92)	(0.53)	(-0.77)	(0.04)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-S	1.23	-0.15	0.73	0.42
(비교지수 대비 성과)	(2.92)	(0.54)	(-0.75)	(0.06)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]ClassC-P	1.18	-0.25	0.58	0.22
(비교지수 대비 성과)	(2.87)	(0.44)	(-0.90)	(-0.14)
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률	1.19	-0.25	0.55	0.17
(비교지수 대비 성과)	(2.88)	(0.44)	(-0.93)	(-0.19)
비교지수(벤치마크)	-1.69	-0.69	1.48	0.36

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI X 20% + KOB120 X 50% + CD91 X 30%

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

구분	최근 1년	최근 2년	최근 3년	최근 5년
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]	1.16	5.12	9.63	19.16
(비교지수 대비 성과)	(0.80)	(6.11)	(7.69)	(12.48)
종류(Class)별 현황				
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-A	0.22	3.16	6.43	13.08
(비교지수 대비 성과)	(-0.14)	(4.15)	(4.49)	(6.40)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-A-E	0.43	3.65	7.42	-
(비교지수 대비 성과)	(0.07)	(4.64)	(5.48)	-
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C-E	0.07	2.86	6.03	12.12
(비교지수 대비 성과)	(-0.29)	(3.85)	(4.09)	(5.44)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C1	-0.28	2.20	4.64	9.20
(비교지수 대비 성과)	(-0.64)	(3.19)	(2.70)	(2.52)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C2	-0.08	2.55	5.24	-1.11
(비교지수 대비 성과)	(-0.44)	(3.54)	(3.30)	(-7.79)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C3	0.12	2.96	-	0.17
(비교지수 대비 성과)	(-0.24)	(3.95)	-	(-6.51)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-C4	0.32	3.38	6.52	12.72
(비교지수 대비 성과)	(-0.04)	(4.37)	(4.58)	(6.04)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-P	0.32	3.37	6.82	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.04)	(4.36)	(4.88)	-
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-P-E	0.40	-	-	-
(비교지수 대비 성과)	(0.04)	-	-	-
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]Class-S	0.42	3.60	7.22	14.52
(비교지수 대비 성과)	(0.06)	(4.59)	(5.28)	(7.84)
알파시나브로공모주1호[주식 혼합]ClassC-P	0.22	3.17	6.50	-
(비교지수 대비 성과)	(-0.14)	(4.16)	(4.56)	-
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률	0.17	2.80	4.25	6.67
(비교지수 대비 성과)	(-0.19)	(3.79)	(2.31)	(-0.01)
비교지수(벤치마크)	0.36	-0.99	1.94	6.68

주) 비교지수(벤치마크) : KOSPI X 20% + KOB120 X 50% + CD91 X 30%

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

▶ 손익현황

(단위: 백만원)

구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	손익합계
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
전기	-145	40	0	-158	0	0	0	0	0	21	-1	-243
당기	-19	35	0	-146	0	0	0	0	0	9	0	-121

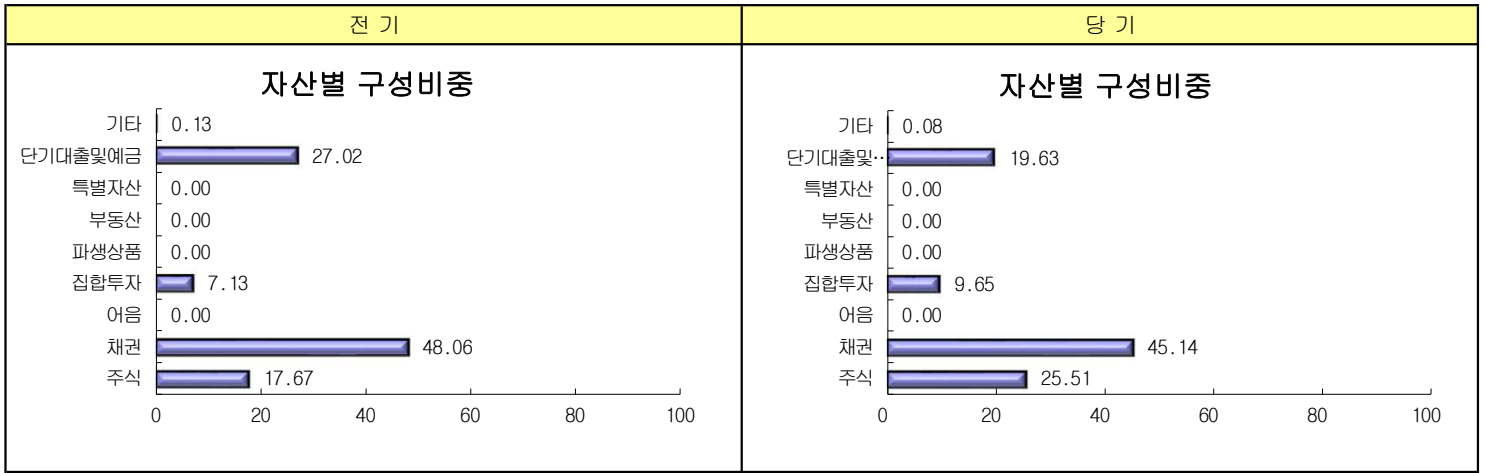
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW	3,545	6,272	0	1,341	0	0	0	0	0	2,727	11	13,896
(1.00)	(25.51)	(45.14)	(0.00)	(9.65)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(0.00)	(19.63)	(0.08)	(100.00)
합계	3,545	6,272	0	1,341	0	0	0	0	0	2,727	11	13,896

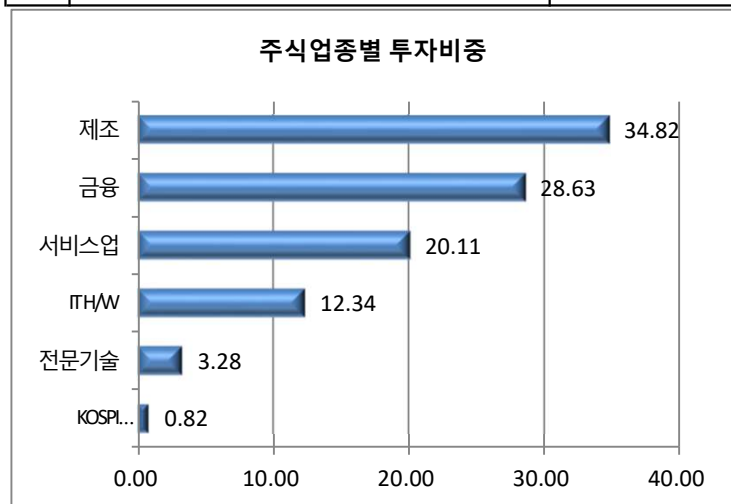
* () : 구성 비중



▶ 주식업종별 투자비중

(단위 : %)

순위	업종명	비중	순위	업종명	비중
1	제조	34.82	6	KOSPI 미분류	0.82
2	금융	28.63	7		
3	서비스업	20.11	8		
4	IT H/W	12.34	9		
5	전문기술	3.28	10		



주) 위 업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

▶ 투자대상 상위 10종목

(단위 : %)

	구분	종목명	비중		구분	종목명	비중
1	채권	통안02140-2006-02	36.16	6	주식	아이티엠반도체	3.94
2	단기상품	은대	19.63	7	주식	대정화금	3.53
3	채권	통안02050-2010-02	7.25	8	집합투자증권	KOSEF 통안채1년	3.23
4	주식	펄텍코리아	6.81	9	채권	국민주택1종15-05	1.57
5	집합투자증권	롯데리츠	6.42	10	주식	그린플러스	0.78

※보다 상세한 투자대상자산 내용은 금융투자협회 전자공시사이트의 펀드 분기영업보고서 및 결산보고서를 참고하실 수 있습니다.(인터넷주소 <http://dis.kofia.or.kr>) 단, 협회 전자공시사이트에서 조회한 분기영업보고서 및 결산보고서는 본 자산운용보고서와 작성기준일이 상이할 수 있습니다.

▼ 각 자산별 보유종목 내역

▶ 주식

(단위: 주, 백만원, %)

종목명	보유수량	평가금액	비중	발행국가	통화	업종	비고
펄텍코리아	54,673	946	6.81	대한민국	KRW	제조	
아이티엠반도체	9,266	548	3.94	대한민국	KRW	IT H/W	
대정화금	32,829	491	3.53	대한민국	KRW	제조	
그린플러스	11,689	108	0.78	대한민국	KRW	제조	
하나금융13호스팩	38,729	78	0.56	대한민국	KRW	전문기술	1%초과(1.14)
한국제8호스팩	37,699	76	0.54	대한민국	KRW	금융	1%초과(1.1)
신영스팩5호	35,816	72	0.52	대한민국	KRW	금융	1%초과(1.02)

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재 또는 발행주식 총수의 1% 초과 종목

▶ 채권

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행국가	통화	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
통안02140-2006-02	5,000	5,025	대한민국	KRW	2018-06-02	2020-06-02		N/A	36.16
통안02050-2010-02	1,000	1,008	대한민국	KRW	2018-10-05	2020-10-05		N/A	7.25
국민주택1종15-05	200	218	대한민국	KRW	2015-05-31	2020-05-31		N/A	1.57

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 집합투자증권

(단위: 좌수, 백만원, %)

종목명	종류	자산운용사	설정원본	순자산금액	발행국가	통화	비중
롯데리츠	수익증권	롯데위탁관리 부동산투자회사	1,150	892	대한민국	KRW	6.42
KOSEF 통안채1년	수익증권	키움투자자산운용	451	449	대한민국	KRW	3.23

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 주, 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	한국증권금융	1999-01-01	2,727	0.46		대한민국	KRW

주) 투자대상 상위 10종목 및 평가금액이 자산총액의 5%를 초과하는 경우 기재

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	생년	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
오한일	차장	1984	15	593	5	180	2112000305
신대철	주임	1990	16	732	7	351	2117000647

주) 성명이 굵은 글씨로 표시된 것이 책임투자운용인력이며, '책임투자운용인력'이란 투자운용인력 중 투자전략 수립 및 투자 의사결정 등에 있어 주도적이고 핵심적인 역할을 수행하는 자를 말함.

* 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

기간	운용전문인력
2018.03.12 ~ 현재	오한일
2019.12.13 ~ 2020.03.31	한희진
2018.03.12 ~ 현재	오한일
2019.12.13 ~ 현재	신대철
2019.12.13 ~ 2020.03.31	한희진

5. 비용 현황

▶ 업자별 보수 지급현황

(단위: 백만원, %)

	구분	전기		당기		
		금액	비율	금액	비율	
알파시나브로공모주1호 [주식혼합]	자산운용사	0	0.00	0	0.00	
	판매회사	0	0.00	0	0.00	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.00	0	0.00	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.00	0	0.00	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	5	0.03	5	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	5	0.03	5	0.03
		증권거래세	2	0.01	4	0.03
Class-A	자산운용사	5	0.10	4	0.10	
	판매회사	6	0.13	4	0.12	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	11	0.24	8	0.23	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
Class-A	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.03	1	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.03	1	0.03
	증권거래세	1	0.01	1	0.03	

Class-A-E	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		0	0.07	0	0.07
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		0	0.18	0	0.18
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.04
	증권거래세		0	0.01	0	0.03
Class-C-E	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		1	0.16	1	0.16
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		1	0.28	1	0.27
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.03
	증권거래세		0	0.01	0	0.03
Class-C1	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		0	0.25	0	0.25
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		0	0.36	0	0.36
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.02	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.02	0	0.03
	증권거래세		0	0.01	0	0.03
Class-C2	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		1	0.20	1	0.20
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		1	0.31	1	0.31
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.03
	증권거래세		0	0.01	0	0.02
Class-C3	자산운용사		4	0.10	2	0.10
	판매회사		7	0.15	3	0.15
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		11	0.26	5	0.26
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.03	1	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.03	1	0.03
	증권거래세		1	0.01	0	0.02

Class-C4	자산운용사		3	0.10	4	0.10
	판매회사		3	0.10	4	0.10
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		7	0.21	9	0.21
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.02	2	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.02	2	0.03
	증권거래세		0	0.01	1	0.03
Class-P	자산운용사		4	0.10	4	0.10
	판매회사		4	0.10	4	0.10
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		8	0.21	7	0.21
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.03	1	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.03	1	0.04
	증권거래세		0	0.01	1	0.03
Class-P-E	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		0	0.08	0	0.08
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		1	0.19	1	0.19
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.03
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.03
	증권거래세		0	0.01	0	0.03
Class-S	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		0	0.08	0	0.07
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		0	0.19	0	0.18
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.04
	증권거래세		0	0.01	0	0.03
ClassC-P	자산운용사		0	0.10	0	0.10
	판매회사		1	0.13	1	0.12
	펀드재산보관회사(신탁업자)		0	0.01	0	0.01
	일반사무관리회사		0	0.00	0	0.00
	보수합계		1	0.24	1	0.23
	기타비용**		0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.04
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.04
	증권거래세		0	0.01	0	0.03

* 펀드의 순자산총액(기간평균) 대비 비율

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

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		총보수·비용비율(A)	매매·중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
알파시나브로공모주1호[주식혼합]	전기	0.0027	0.1093	0.112
	당기	0.0027	0.1389	0.1416
종류(Class)별 현황				
Class-A	전기	0.9471	0.1038	1.0509
	당기	0.9497	0.1364	1.0861
Class-A-E	전기	0.7435	0.0742	0.8177
	당기	0.7449	0.1108	0.8557
Class-C-E	전기	1.0964	0.1068	1.2032
	당기	1.0995	0.1323	1.2318
Class-C1	전기	1.4463	0.0366	1.4829
	당기	1.4494	0.0625	1.5119
Class-C2	전기	1.2468	0.0641	1.3109
	당기	1.2495	0.1541	1.4036
Class-C3	전기	1.0471	0.1091	1.1562
	당기	1.05	0.135	1.185
Class-C4	전기	0.847	0.119	0.966
	당기	0.8494	0.1374	0.9868
Class-P	전기	0.847	0.1168	0.9638
	당기	0.8494	0.1441	0.9935
Class-P-E	전기	0.7665	0.1431	0.9096
	당기	0.7687	0.1539	0.9226
Class-S	전기	0.7439	0.1118	0.8557
	당기	0.7458	0.1419	0.8877
ClassC-P	전기	0.9463	0.1143	1.0606
	당기	0.9491	0.1416	1.0907

주1) 총보수·비용비율(Total Expense Ratio)이란 운용보수 등 펀드에서 부담하는 '보수'와 '기타비용' 총액을 순자산 연평잔액(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

(단위: 백만원, %)

매수		매도		매매회전율(주)	
수량	금액	수량	금액	해당기간	연환산
77,770	1,657	95,447	1,679	50.04	202.94

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식금액의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가액으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위 : %)

2019년08월11일 ~ 2019년11월10일	2019년11월11일 ~ 2020년02월10일	2020년02월11일 ~ 2020년05월10일
32.66	32.08	50.04

공지사항

이 보고서는 자본시장법에 의해 알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]의 자산운용회사인 알파자산운용이 작성하여 펀드재산보관회사(신탁업자)인 한국증권금융의 확인을 받아 판매회사인 NH농협은행, NH투자증권, 교보증권, 대신증권, 신영증권, 우리은행, 유안타증권, 이베스트투자증권, 키움증권, 하나금융투자, 하나은행, 한국투자증권, 한국포스증권, 한화투자증권을 통해 투자자에게 제공됩니다. 다만 일괄 예약된 펀드의 펀드재산보관회사(신탁업자) 확인기간은 일괄 예약된 날 이후 기간에 한합니다.