

자산운용보고서

알파시나브로공모주증권투자신탁1호[주식혼합]

(운용기간 : 2020년05월11일 ~ 2020년08월10일)

○ 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.alphasset.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	2020.05.11 ~ 2020.08.10	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	<ul style="list-style-type: none"> ■ 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
알파시나브로 공모주1호[주식혼합]	자산 총액 (A)	13,896	18,245	31.29
	부채 총액 (B)	0	115	33521.59
	순자산총액 (C=A-B)	13,896	18,130	30.47
	발행 수익증권 총 수 (D)	13,865	17,211	24.13
	기준가격 ^{주)} (E=C/D×1000)	1,002.18	1,053.34	5.10
종류(Class)별 기준가격 현황				
Class-A	기준가격	997.51	1,046.01	4.86
Class-A-E	기준가격	998.58	1,047.66	4.91
Class-C-E	기준가격	996.78	1,044.83	4.82
Class-C1	기준가격	995.08	1,042.12	4.73
Class-C2	기준가격	996.05	1,043.70	4.78
Class-C3	기준가격	997.02	1,045.24	4.84
Class-C4	기준가격	998.01	1,046.78	4.89
Class-P	기준가격	998.01	1,046.78	4.89
Class-P-E	기준가격	998.40	1,047.40	4.91
Class-S	기준가격	998.52	1,047.59	4.91
ClassC-P	기준가격	997.52	1,046.01	4.86

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 26건의 수요예측 중 18건의 종목을 배정받음.
일반 IPO 공모주 시장은 지난 분기 대비 종목 수가 증가하였음.
SPAC IPO는 해당기간 동안 총 6건의 수요예측 중 5건을 참여하였고, 5건의 종목을 배정받음.
- 동 기간동안 수요예측 기관 경쟁률은 평균 759 : 1 수준으로 지난 분기보다 상승하였으며, 에스씨엠생명과학, 엘이티, 마크로밀엠브레인, 에스케이바이오팜, 위더스제약, 신도기연, 에이프로, 티에스아이, 제놀루션, 이엔드디, 이루다, 한국파마, 영림원소프트랩, 미투젠, 셀레믹스, 아이디피 등 16 종목이 평균을 상회하는 높은 경쟁률을 보임.
- 동 기간동안 상장한 공모주는 21개 종목이며 상장일 증가 기준으로 평균수익률은 73.7% 수준으로 지난 분기 대비 상승함.
평균수익률을 상회한 종목은 드림씨아이에스(배정), 에스씨엠생명과학(배정), 엘이티(배정), 마크로밀엠브레인(배정), 에스케이바이오팜(배정), 위더스제약(배정), 에이프로(배정), 이루다(배정), 한국파마(배정)로 총 9개 종목이 있었음.

[채권]

- 5월 채권시장은 금통위에서 국고채 매입 관련하여 구체적으로 언급하지 않아 월 후반 장기물 강세가 제한되었으며, 3년물 이하 단기물의 강세가 두드러지며 커브 스티프닝이 발생하였음.
- 6월 채권시장은 한국은행의 추가 정책 기대 약화와 3차 추경 확대 등에 대한 경계로 인해 박스권 등락을 하였음.
- 7월 채권시장은 미 경기 회복 기대 약화, 미국 2분기 GDP 성장을 부진 등으로 인해 채권 강세를 불러왔으며, 특히 장기물 금리를 하락시키며 커브 플랫폼닝이 발생하였음.
- 국채 외에 우량한 회사채, 공사채 등을 매수하며 안정성과 수익성을 높이기 위해 포트폴리오를 운용 중.

▶ 투자환경 및 운용 계획

[주식]

- 8월 중순부터 코로나19 2차 팬데믹에 대한 우려가 지속되고 있으나 출회 매물을 빠르게 소화해 나가며 재차 반등하는 모습을 보이고 있음. 이 외에 인플레이션 우려, 미국 대선 불확실성 등이 증시 조정 요인이 될 것으로 보이나 풍부한 유동성을 바탕으로 저가 매수세는 지속적으로 있을 것으로 보임.
- 9월 이후 IPO 시장은 공모규모, 상장기업수에서 지난 분기 대비 상승할 것으로 전망됨. 코로나19로 인해 상장을 연기한 기업들과 빅히트엔터테인먼트 등 대어급 공모주가 대기 중이며 하반기 공모주 시장은 성수기를 맞이할 가능성이 높음.
- 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]

- 9월 이후 미 연준의 평균인플레이션 목표제는 기대 인플레를 높게 유지시키는 동시에 유동성 공급안 등 저금리 기조를 유지시켜 실질 금리 마이너스 구간을 장기화하는 것을 목표로 두고 있으며, 경기 회복기대 제한등으로 인해 금리의 대세 상승 구간은 아니라고 판단.
- 9월 FOMC 통해서 유동성 공급 기조를 재확인하면서 채권시장 약세는 진정을 찾을 수 있을 것이라고 판단하며, 미국 대선이 가까워질수록 정치 불확실성의 증가로 인해 추가 금리 상승은 제한 될 것으로 판단됨.

▶ 기간(누적)수익률

(단위 : %)

구분	최근 3개월	최근 6개월	최근 9개월	최근 12개월
알파시나브로 공모주1호 [주식혼합]	5.10	6.59	5.33	6.45
(비교지수 대비 성과)	(0.54)	(3.79)	(1.49)	(0.35)
종류(Class)별 현황				
Class-A	4.86	6.10	4.60	5.47
(비교지수 대비 성과)	(0.30)	(3.30)	(0.76)	(-0.63)
Class-A-E	4.91	6.21	4.77	5.69
(비교지수 대비 성과)	(0.35)	(3.41)	(0.93)	(-0.41)
Class-C-E	4.82	6.02	4.48	5.31
(비교지수 대비 성과)	(0.26)	(3.22)	(0.64)	(-0.79)
Class-C1	4.73	5.84	4.21	4.94
(비교지수 대비 성과)	(0.17)	(3.04)	(0.37)	(-1.16)
Class-C2	4.78	5.95	4.37	5.16
(비교지수 대비 성과)	(0.22)	(3.15)	(0.53)	(-0.94)
Class-C3	4.84	6.05	4.52	5.36
(비교지수 대비 성과)	(0.28)	(3.25)	(0.68)	(-0.74)
Class-C4	4.89	6.16	4.68	5.57
(비교지수 대비 성과)	(0.33)	(3.36)	(0.84)	(-0.53)
Class-P	4.89	6.15	4.68	5.57
(비교지수 대비 성과)	(0.33)	(3.35)	(0.84)	(-0.53)
Class-P-E	4.91	6.20	4.74	5.65
(비교지수 대비 성과)	(0.35)	(3.40)	(0.90)	(-0.45)
Class-S	4.91	6.21	4.76	5.68
(비교지수 대비 성과)	(0.35)	(3.41)	(0.92)	(-0.42)
ClassC-P	4.86	6.10	4.60	5.47
(비교지수 대비 성과)	(0.30)	(3.30)	(0.76)	(-0.63)

CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률 (비교지수 대비 성과)	4.85 (0.29)	6.09 (3.29)	4.58 (0.74)	5.43 (-0.67)
비교지수(벤치마크)	4.56	2.80	3.84	6.10

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
알파시나브로 공모주1호 [주식혼합] (비교지수 대비 성과)	6.45 (0.35)	9.86 (5.24)	15.31 (9.86)	20.34 (8.40)
종류(Class)별 현황				
Class-A (비교지수 대비 성과)	5.47 (-0.63)	7.82 (3.20)	12.01 (6.56)	14.26 (2.32)
Class-A-E (비교지수 대비 성과)	5.69 (-0.41)	8.32 (3.70)	13.02 (7.57)	- -
Class-C-E (비교지수 대비 성과)	5.31 (-0.79)	7.50 (2.88)	11.56 (6.11)	13.31 (1.37)
Class-C1 (비교지수 대비 성과)	4.94 (-1.16)	6.75 (2.13)	10.23 (4.78)	10.45 (-1.49)
Class-C2 (비교지수 대비 성과)	5.16 (-0.94)	7.18 (2.56)	10.84 (5.39)	- -
Class-C3 (비교지수 대비 성과)	5.36 (-0.74)	7.61 (2.99)	- -	1.26 (-10.68)
Class-C4 (비교지수 대비 성과)	5.57 (-0.53)	8.04 (3.42)	12.18 (6.73)	13.98 (2.04)
Class-P (비교지수 대비 성과)	5.57 (-0.53)	8.03 (3.41)	12.39 (6.94)	- -
Class-P-E (비교지수 대비 성과)	5.65 (-0.45)	- -	- -	- -
Class-S (비교지수 대비 성과)	5.68 (-0.42)	8.27 (3.65)	12.81 (7.36)	15.67 (3.73)
ClassC-P (비교지수 대비 성과)	5.47 (-0.63)	7.82 (3.20)	12.06 (6.61)	- -
CDSC 적용펀드 통합 수익률				
CDSC통합수익률 (비교지수 대비 성과)	5.43 (-0.67)	7.51 (2.89)	8.65 (3.20)	7.96 (-3.98)
비교지수(벤치마크)	6.10	4.62	5.45	11.94

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			
전 기	-19	35	0	-146	0	0	0	0	0	9	0	-121
당 기	798	17	14	-21	0	0	0	0	0	2	0	811

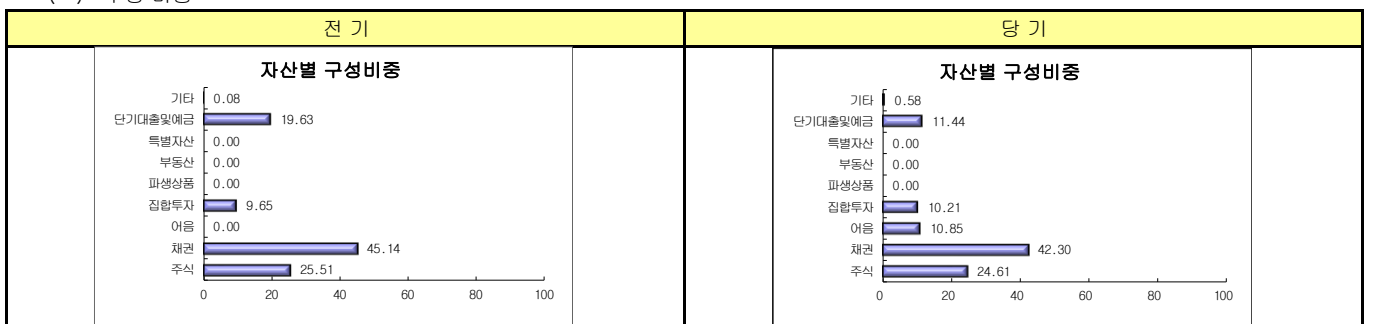
3. 자산현황

▶ 자산구성현황

(단위: 백만원, %)

통화별 구분	증권				파생상품		부동산	특별자산		단기대출및 예금	기타	자산총액
	주식	채권	어음	집합투자	장내	장외		실물자산	기타			
KRW (1.00)	4,491 (24.61)	7,718 (42.30)	1,979 (10.85)	1,864 (10.21)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	0 (0.00)	2,087 (11.44)	106 (0.58)	18,245 (100.00)
합 계	4,491	7,718	1,979	1,864	0	0	0	0	0	2,087	106	18,245

* () : 구성 비중

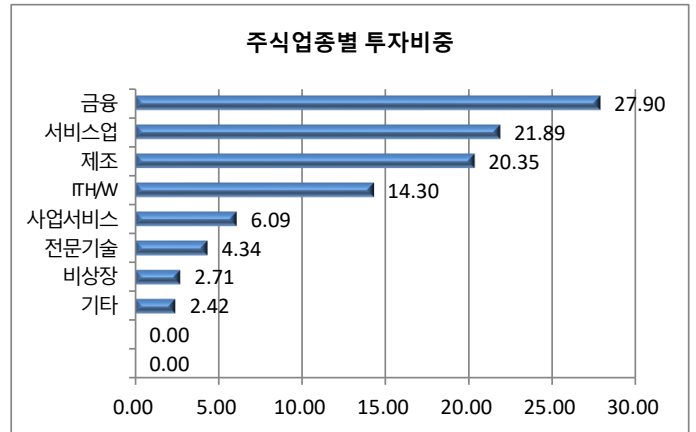


▶ **주식업종별 투자비중**

(단위 : %)

업종구분은 한국거래소의 업종구분을 따릅니다.

순위	업종명	비중
1	금융	27.90
2	서비스업	21.89
3	제조	20.35
4	IT H/W	14.30
5	사업서비스	6.09
순위	업종명	비중
6	전문기술	4.34
7	비상장	2.71
8	기타	2.42
9		
10		



▶ **투자대상 상위 10종목**

(단위 : %)

구분	종목명	비중	구분	종목명	비중		
1	단기상품	은대	11.44	6	채권	신한금융지주100	5.53
2	채권	현대캐피탈1498	5.60	7	채권	산은캐피탈593-2	5.51
3	채권	기업은행(신)1808013A-17	5.59	8	채권	통안02050-2010-02	5.51
4	채권	지에스이피에스10	5.54	9	어음	CP(한국캐피탈0212-1217)	5.44
5	채권	삼성증권11	5.53	10	어음	CP(아프로파이낸셜대부 0130-0128)	5.41

※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
엔에이치스팩15호	78,698	161	0.88	대한민국	KRW	전문기술	1%초과(1.2)
IBKS제13호스팩	76,730	155	0.85	대한민국	KRW	금융	1%초과(1.48)
하나금융16호스팩	59,500	120	0.66	대한민국	KRW	금융	1%초과(1.48)
교보8호스팩	39,198	85	0.47	대한민국	KRW	금융	1%초과(1.05)
교보9호스팩	41,931	84	0.46	대한민국	KRW	전문기술	1%초과(1.08)
이베스트스팩5호	40,000	80	0.44	대한민국	KRW	금융	1%초과(1.1)
한국제8호스팩	37,699	76	0.42	대한민국	KRW	금융	1%초과(1.1)
신영스팩5호	35,816	74	0.40	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
현대캐피탈1498	1,000	1,021	대한민국	KRW	2014-04-15	2021-04-15		AA0	5.60
기업은행(신)1808013A-1	1,000	1,020	대한민국	KRW	2018-08-17	2021-08-17		AAA	5.59
지에스이피에스10	1,000	1,011	대한민국	KRW	2015-11-24	2020-11-24		AA-	5.54
삼성증권11	1,000	1,010	대한민국	KRW	2017-12-07	2020-12-07		AA+	5.53
신한금융지주100	1,000	1,010	대한민국	KRW	2015-12-02	2020-12-02		AAA	5.53
산은캐피탈593-2	1,000	1,005	대한민국	KRW	2017-10-13	2020-10-13		AA-	5.51
통안02050-2010-02	1,000	1,004	대한민국	KRW	2018-10-05	2020-10-05		N/A	5.51

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

▶ **어음**

(단위: 백만원, %)

종목명	액면가액	평가액	발행일	상환일	보증기관	신용등급	비중
CP(한국캐피탈0212-1217)	1,000	993	2020-02-12	2020-12-17		A2-	5.44
CP(아프로파이낸셜대부0130-0128)	1,000	987	2020-01-30	2021-01-28		A2-	5.41

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

▶ 단기대출 및 예금

(단위: 백만원, %)

종류	금융기관	취득일자	금액	금리	만기일	발행국가	통화
예금	한국증권금융	1999-01-01	2,087	0.23		대한민국	KRW

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

4. 투자운용전문인력 현황

▶ 투자운용인력(펀드매니저)

(단위 : 개, 억원)

성명	직위	나이	운용중인 펀드 현황		성과보수가 있는 펀드 및 일임계약 운용규모		협회등록번호
			펀드개수	운용규모	펀드개수	운용규모	
오한일	차장	37	13	605	5	182	2112000305
신대철	주임	31	14	736	7	343	2117000647

※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, %)

	구 분	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	9	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	5	0.03	9	0.05
		증권거래세	4	0.03	6	0.04
Class-A	자산운용사	4	0.10	3	0.10	
	판매회사	4	0.12	4	0.13	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	8	0.23	7	0.24	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.03	2	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.03	2	0.05
		증권거래세	1	0.03	1	0.04
	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	0	0.07	0	0.07	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	

Class-A-E	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	0.04	0	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.04	0	0.05
	증권거래세	0	0.03	0	0.04	
Class-C-E	자산운용사	0	0.10	1	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	0.27	2	0.28	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.05
조사분석업무 등 서비스 수수료		0	0.00	0	0.00	
합계		0	0.03	0	0.05	
증권거래세	0	0.03	0	0.04		
Class-C1	자산운용사	0	0.10	2	0.10	
	판매회사	0	0.25	5	0.25	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	0	0.36	7	0.36	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	1	0.06
조사분석업무 등 서비스 수수료		0	0.00	0	0.00	
합계		0	0.03	1	0.06	
증권거래세	0	0.03	1	0.05		
Class-C2	자산운용사	0	0.10	0	0.10	
	판매회사	1	0.20	0	0.20	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	1	0.31	0	0.31	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.03	0	0.05
조사분석업무 등 서비스 수수료		0	0.00	0	0.00	
합계		0	0.03	0	0.05	
증권거래세	0	0.02	0	0.03		
Class-C3	자산운용사	2	0.10	0	0.10	
	판매회사	3	0.15	0	0.15	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	5	0.26	0	0.26	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.03	0	0.06
조사분석업무 등 서비스 수수료		0	0.00	0	0.00	
합계		1	0.03	0	0.06	
증권거래세	0	0.02	0	0.04		
Class-C4	자산운용사	4	0.10	6	0.10	
	판매회사	4	0.10	6	0.10	
	펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01	
	일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00	
	보수합계	9	0.21	12	0.21	
	기타비용**	0	0.00	0	0.00	
	단순매매.중개수수료	2	0.03	3	0.05	

	매매, 중개 수수료	조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	2	0.03	3	0.05
		증권거래세	1	0.03	2	0.04
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	7	0.21	8	0.21
		기타비용**	0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	1	0.04	2	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	1	0.04	2	0.05
		증권거래세	1	0.03	1	0.04
Class-P-E		자산운용사	0	0.10	1	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	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.03	0	0.05
		증권거래세	0	0.03	0	0.04
Class-S		자산운용사	0	0.10	0	0.10
		판매회사	0	0.07	0	0.08
		펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01
		일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
		보수합계	0	0.18	0	0.19
		기타비용**	0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.04	0	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.04	0	0.05
		증권거래세	0	0.03	0	0.04
ClassC-P		자산운용사	0	0.10	0	0.10
		판매회사	1	0.12	1	0.13
		펀드재산보관회사(신탁업자)	0	0.01	0	0.01
		일반사무관리회사	0	0.00	0	0.00
		보수합계	1	0.23	1	0.24
		기타비용**	0	0.00	0	0.00
	매매, 중개 수수료	단순매매.중개수수료	0	0.04	0	0.05
		조사분석업무 등 서비스 수수료	0	0.00	0	0.00
		합계	0	0.04	0	0.05
		증권거래세	0	0.03	0	0.04

* 펀드의 순자산총액(기간평잔) 대비 비율

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

▶ 총보수,비용비율

(단위 : 연환산, %)

		총보수 · 비용비율(A)	매매 · 중개수수료 비율(B)	합계(A+B)
알파시나브로공모주1호[주식혼합]	전기	0.0027	0.1389	0.1416
	당기	0.0025	0.1875	0.19
종류(Class)별 현황				
Class-A	전기	0.9497	0.1364	1.0861
	당기	0.9495	0.185	1.1345
Class-A-E	전기	0.7449	0.1108	0.8557
	당기	0.7418	0.2625	1.0043

Class-C-E	전기	1.0995	0.1323	1.2318
	당기	1.0995	0.1895	1.289
Class-C1	전기	1.4494	0.0625	1.5119
	당기	1.4505	0.2197	1.6702
Class-C2	전기	1.2495	0.1541	1.4036
	당기	1.2493	0.1816	1.4309
Class-C3	전기	1.05	0.135	1.185
	당기	1.0498	0.1926	1.2424
Class-C4	전기	0.8494	0.1374	0.9868
	당기	0.8493	0.1755	1.0248
Class-P	전기	0.8494	0.1441	0.9935
	당기	0.8493	0.1864	1.0357
Class-P-E	전기	0.7687	0.1539	0.9226
	당기	0.7686	0.1925	0.9611
Class-S	전기	0.7458	0.1419	0.8877
	당기	0.7455	0.1945	0.94
ClassC-P	전기	0.9491	0.1416	1.0907
	당기	0.9489	0.1882	1.1371

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
375,607	1,981	185,005	2,536	64.89	257.46

주) 해당 운용기간 중 매도한 주식가격의 총액을 그 해당 운용기간 중 보유한 주식의 평균가격으로 나눈 비율

▶ 최근 3분기 매매회전율 추이

(단위: %)

2019년11월11일 ~ 2020년02월10일	2020년02월11일 ~ 2020년05월10일	2020년05월11일 ~ 2020년08월10일
32.08	50.04	64.89

공지사항

▶ 자산운용사의 고유재산 투자에 관한 사항

펀드명칭	투자금액 (단위: 원)	수익률 (단위: %)
알파시나브로공모주1호[주식혼합]ClassC	200,000,000	2.17

주) 투자금액 및 투자금 회수는 자산운용사의 손익구조 또는 자금사정을 고려하여 결정 됩니다.

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.