

Fund Facts

4가 +
 . (, Event Arbitrage)
 2003-12-02
 47
 0.5% + 1.07%
 30 70% 30 -90 , 30%

	1	3	6	1	
	-0.17%	-0.14%	0.60%	1.44%	41.76%
	-2.14%	-0.57%	1.21%	1.45%	5.45%

2011 7 41.76% 5.45% -0.17%

1. 7 가 가 가 가

가 가 가 1.55%

가 가 가 가 가

가 , GS, , S-Oil,

가 .7 GSS-Oil NHN, CJ

E&M 가 STX .7 -0.26%

2. Day Position 가 가

3. 가 가

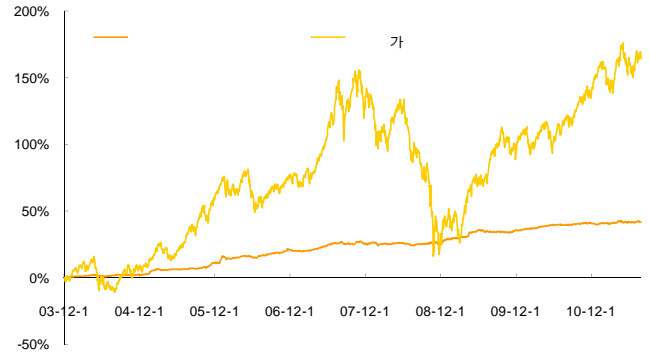
4. Event Arbitrage 7 8

5. 7 Event Arbitrage 0.23%

가 (flattening) 5 2

가 8 가 5 2

-0.02% 2 .7



[2011.07.31]

전략	7월 중		운용개시 이후	
	월간	연환산	누적	연환산
포트폴리오헤지전략	-0.26%	-3.32%	19.82%	2.59%
선물시스템트레이딩	0.00%	0.00%	-3.21%	-0.42%
옵션합성전략	0.00%	0.00%	0.29%	0.04%
Event Arbitrage 등	0.23%	2.84%	13.27%	1.73%
채권/유동성	-0.02%	-0.21%	20.94%	2.73%
비용	-0.11%	-1.45%	-9.35%	-1.22%
합계	-0.17%	-2.14%	41.76%	5.45%

*운용개시이후 전략별 누적수익률은 총누적수익률을 부문별 월간수익률 합계기준으로 발표한 수치임

구분		평가금액(백만원)	비율
주식	현물주식	1,242	26.08%
	선물매도	1,203	-25.26%
	순매수포지션	39	0.82%
채권/유동성		3,520	73.92%
순자산총액		4,762	100%