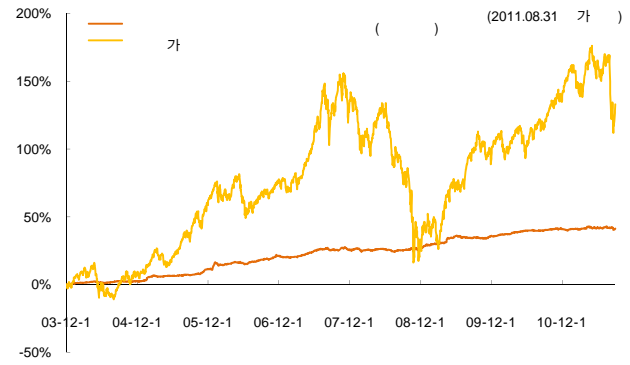


Fund Facts

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

| | | | | | |
|--|--------|--------|-------|-------|--------|
| | 1 | 3 | 6 | 1 | |
| | -0.38% | -0.68% | 0.33% | 0.79% | 41.21% |
| | -4.25% | -2.68% | 0.66% | 0.79% | 5.32% |



2011 8 41.21% 5.32%

1. 가
 가
 11.9%
 LG
 GS, LG
 KT&G, SK C&C,
 GS, S-Oil, LG
 -0.50%

2. Day Position 가 ()가
 가
 1 가
 -0.06% .9

3. 가 가

4. Event Arbitrage
 8 0.07% .8 가 가
 ,9

5. 8 2 1 0.24%

[2011.08.31]

| 전략 | 8월중 | | 운용개시 이후 | |
|-------------------|--------|--------|---------|--------|
| | 월간 | 연환산 | 누적 | 연환산 |
| 포트폴리오헤지전략 | -0.50% | -5.54% | 19.55% | 2.52% |
| 선물시스템트레이딩 | -0.06% | -0.62% | -3.16% | -0.41% |
| 옵션합성전략 | 0.00% | 0.00% | 0.28% | 0.04% |
| Event Arbitrage 등 | 0.07% | 0.83% | 13.10% | 1.69% |
| 재권/유동성 | 0.24% | 2.61% | 20.66% | 2.66% |
| 비용 | -0.14% | -1.53% | -9.23% | -1.19% |
| 합계 | -0.38% | -4.26% | 41.21% | 5.32% |

| | | 가 () | |
|---|--|-------|---------|
| | | 1,099 | 23.13% |
| | | -966 | -20.33% |
| | | 133 | 2.80% |
| / | | 3,652 | 76.87% |
| | | 4,751 | 100% |