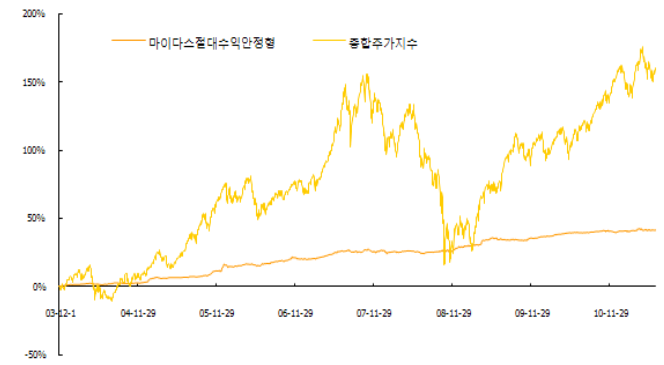


Fund Facts

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

	1	3	6	1	
	-0.12%	0.38%	1.43%	1.36%	42.00%
	-1.50%	1.53%	2.89%	1.36%	5.54%



2011 6 42.00% 5.54% -0.12%
 1. 가 Credit Risk 1.95% QE2
 , LG , LG , LG , GS , SK , GS , BS , LG
 , GS , SKC , KT , 6
 가 -0.31% IT, LG

2. Day Position 가 ()가
 가 가

3. 가 가

4. Event Arbitrage 0.16%

5. 가 가 1 -2 / 0.15%

[2011.06.30]

전략	6월중		운용개시 이후	
	월간	연환산	누적	연환산
포트폴리오헤지전략	-0.31%	-3.75%	20.44%	2.70%
선물시스템트레이딩	0.00%	0.00%	-3.20%	-0.42%
옵션합성전략	0.00%	0.00%	0.29%	0.04%
Event Arbitrage 등	0.16%	1.89%	12.79%	1.69%
채권/유동성	0.15%	1.77%	20.73%	2.73%
비용	-0.12%	-1.41%	-9.05%	-1.19%
합계	-0.12%	-1.50%	42.00%	5.54%

구분		평가금액(백만원)	비율
주식	현물주식	1,377	29.09%
	선물매도	-1,245	-26.30%
	순매수포지션	132	2.79%
채권/유동성		3,356	70.91%
순자산총액		4,733	100%