

Fund Facts

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

	1	3	6	1	
	-1.01%	-1.81%	-1.95%	-1.64%	39.19%
	-11.83%	-7.04%	-3.85%	-1.63%	4.95%



2011 10 39.19% 4.95%
 -1.01%
 1. 10 가 1,909pt
 3 GDP 가
 IT 가
 가가 CJ E&M, GKL, BS IT, SDI, LG
 가 LG
 가 -1.01%
 2. Day Position ()가
 가 .11
 3. 가 가
 4. Event Arbitrage 10 8 가 .11 YG
 Event Arbitrage
 5. 10 3 0.21%

[2011.10.31]

전략	10월중		운용개시 이후	
	월간	연환산	누적	연환산
포트폴리오헤지전략	-1.10%	-12.97%	18.13%	2.29%
선물시스템트레이딩	0.00%	0.00%	-3.43%	-0.43%
옵션합성전략	0.00%	0.00%	0.30%	0.04%
Event Arbitrage 등	0.00%	0.00%	13.82%	1.74%
채권/유동성	0.21%	2.48%	22.24%	2.81%
비용	-0.11%	-1.35%	-10.11%	-1.28%
합계	-1.01%	-11.84%	39.19%	4.95%

*운용개시이후 전략별 누적수익률은 운용적수익률을 부문별 월간수익률 합계기준으로 산출한 수치임

구분		평가금액(백만원)	비율
주식	현물주식	1,091	22.82%
	선물매도	-1,131	-23.66%
	순매수포지션	40	-0.84%
채권/유동성		3,690	77.18%
순자산총액		4,781	100%