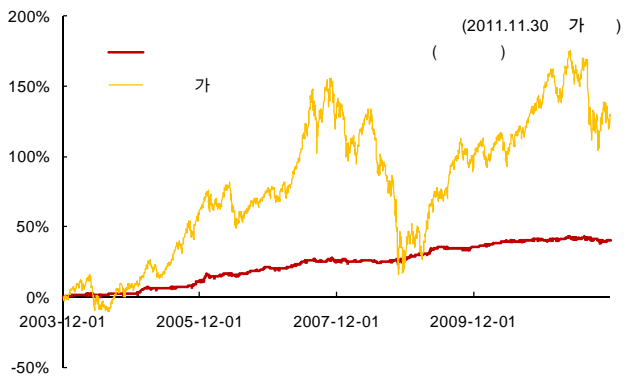


Fund Facts

4가 +
 . ()
 , Event Arbitrage)
 2003-12-02
 49
 0.5% + 1.07%
 30 70% 30 -90 , 30%

	1	3	6	1	
	1.00%	-0.45%	-1.12%	-0.23%	40.58%
	12.13%	-1.81%	-2.24%	-0.23%	5.07%



2011 11 40.58% 5.07% 1.00% 가
 [] 11 가 3.22% 1,848pt 가 7%
 , FRB ECB 가 11
 . 가 가
 1. 가 0.91% .11 LG LG .11 LG
 , LG , NHN, SK , BS , GKL , IT 3
 , LG 가 가
 2. Day 가 , Position 가 .11)가 가 가
 . 12 가 가 0.01% 가 가
 3. 가 11 0.04% 가 가
 4. Event Arbitrage , YG
 11 GS .11 Event Arbitrage
 5. 11 가 가 가 가 가 가
 3 가 가 가 가 가 가
 . 11 0.27%

[2011.11.30]

전략	11 월 중		유증개시 이후	
	월간	연환산	누적	연환산
포트폴리오헤지전략	0.91%	11.06%	18.52%	2.31%
선물시스템트레이딩	0.01%	0.09%	-3.29%	-0.41%
옵션합성전략	0.04%	0.52%	0.34%	0.04%
Event Arbitrage 등	-0.07%	-0.80%	13.22%	1.65%
채권/유동성	0.27%	3.27%	21.72%	2.71%
비용	-0.17%	-2.01%	-9.92%	-1.24%
합계	1.00%	12.13%	40.58%	5.07%

※유증개시이후 누적수익률은 총누적수익률을 무증개시 월간수익률 합계기점으로 안표한 수치임

구분	평가금액(백만원)	비율
주식	현물주식	1,113 22.81%
	선물매도	- 1,083 -22.20%
	순매수포지션	30 0.61%
채권/유동성	3,766	77.19%
순자산총액	4,879	100%