

펀드명 : 트러스트인덱스알파(자)[주식-파생형]

공시일: 2014-09-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 3,248 | 0     | 3,248     | 장내 |
| 합계 |      |      | 3,248 | 0     | 3,248     |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

262

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

170