

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

공시일: 2015-09-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	345	-345	장내
누계	주가지수	선물	1,609	0	1,609	장내
합계			1,609	0	1,609	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

128

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

90