

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

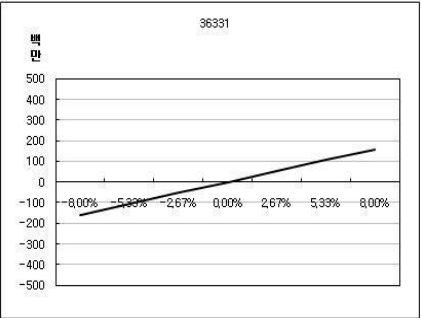
공시일: 2017-02-02

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   | 135   | 0     | 135       | 장내 |
| 합계 |      |      | 135   | 0     | 135       |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7

## 펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

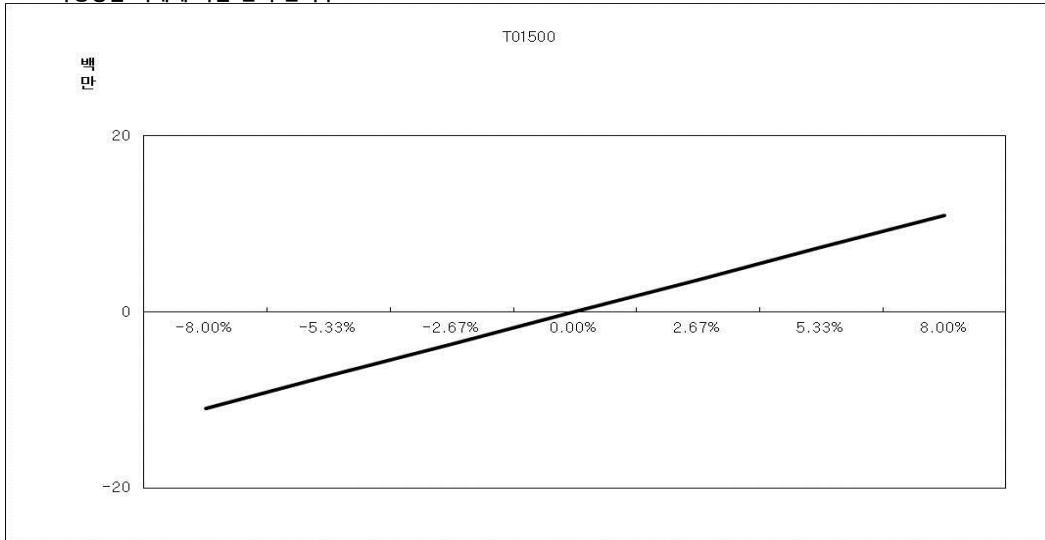
공시일: 2017-02-02

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 24    | 0     | 24        | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 0     | 388   | -388      | 장외 |
| 합계 |      |      | 1,630 | 2,018 | -388      |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

85