

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

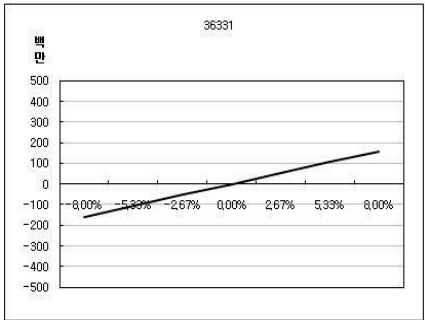
공시일: 2017-04-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	70	-70	장내
누계	주가지수	선물	70	0	70	장내
합계			70	0	70	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

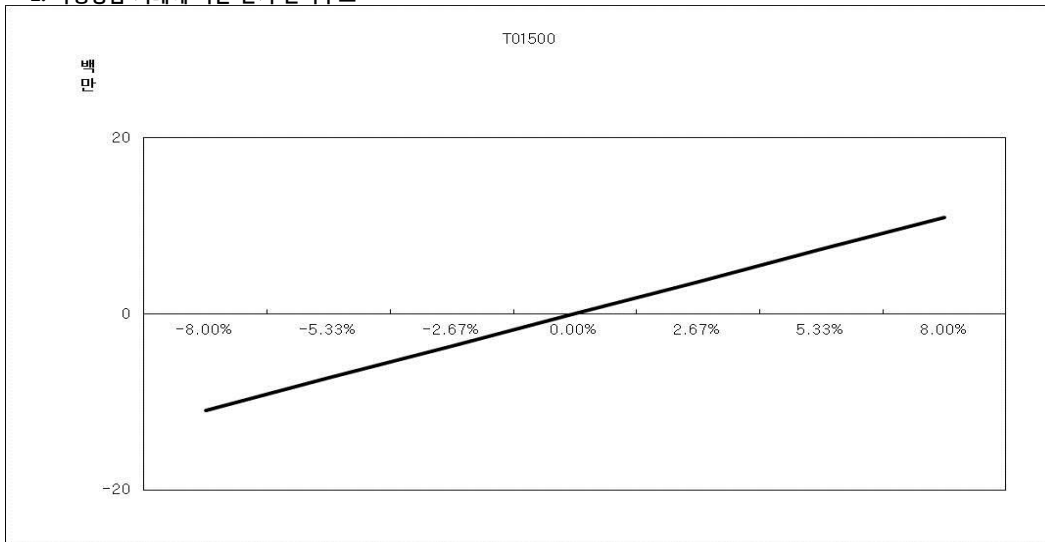
공시일: 2017-04-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	5	0	5	장외
누계	주가지수	스왑	238	0	238	장외
합계			2,308	2,070	238	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

78