

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

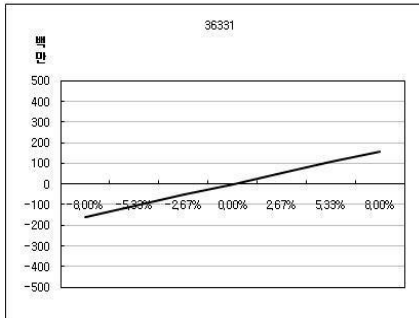
공시일: 2017-05-16

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 | 75 | 0 | 75 | 장내 |
| 합계 | | | 75 | 0 | 75 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

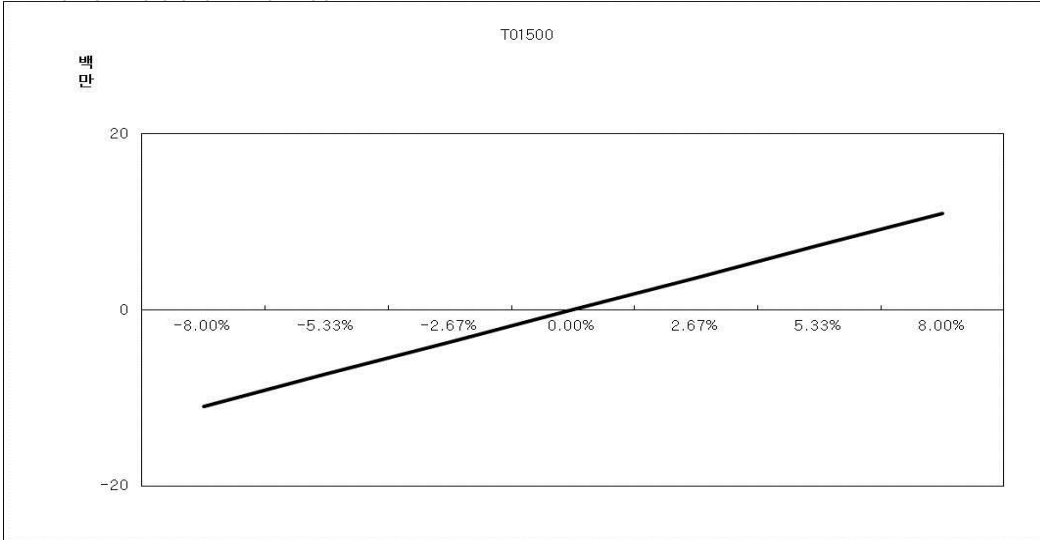
공시일: 2017-05-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 74 | 0 | 74 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 51 | 0 | 51 | 장외 |
| 합계 | | | 2,340 | 2,288 | 51 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

80