

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

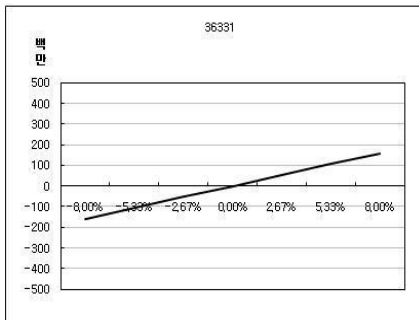
공시일: 2017-07-07

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 | 78 | 0 | 78 | 장내 |
| 합계 | | | 78 | 0 | 78 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

4

펀드명 : 트러스트정정당당[주식-파생형](모)

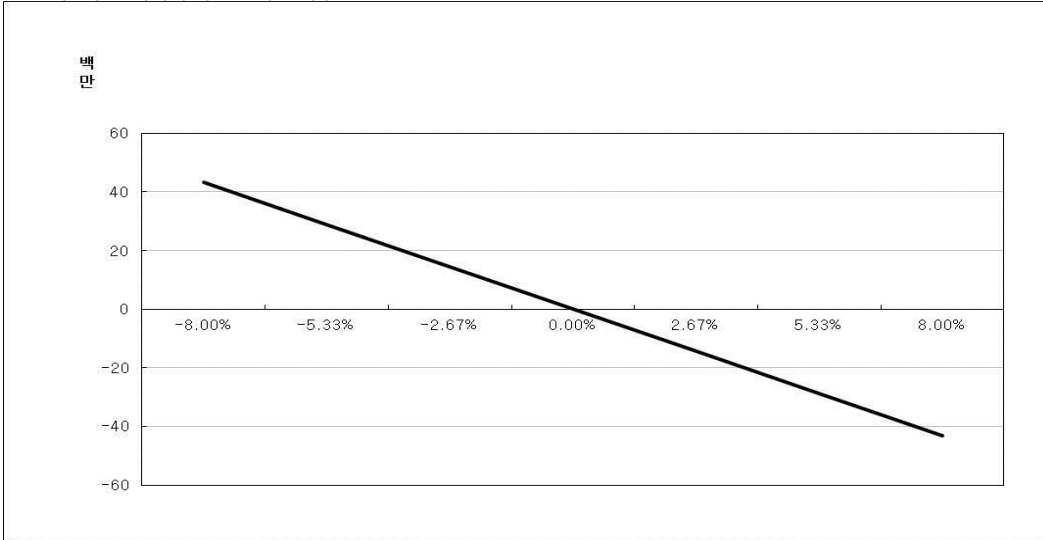
공시일: 2017-07-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 546 | 0 | 546 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 2,651 | -2,651 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 2,651 | -2,651 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

212

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

129

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

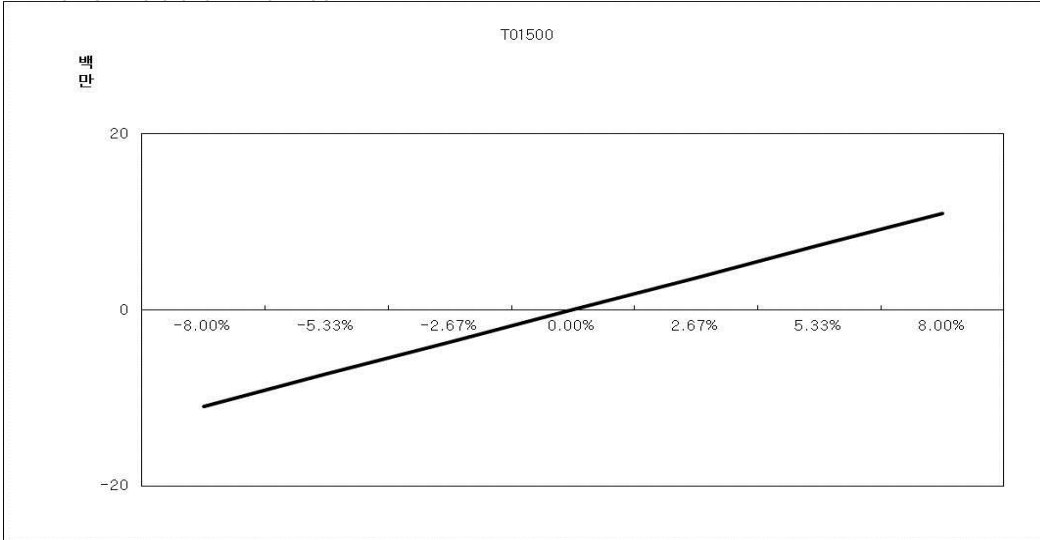
공시일: 2017-07-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 10 | 0 | 10 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 117 | 0 | 117 | 장외 |
| 합계 | | | 2,166 | 2,049 | 117 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

64