

펀드명 : 트러스트인덱스알파(자)[주식-파생형]

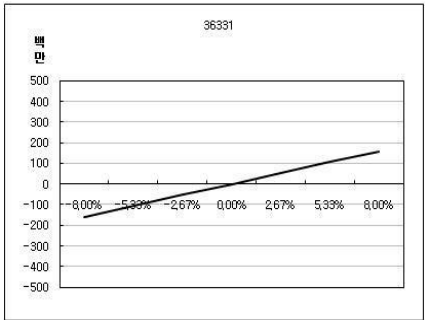
공시일: 2017-08-30

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	463	0	463	장내
합계			463	0	463	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

23

펀드명 : 트러스트정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2017-08-30

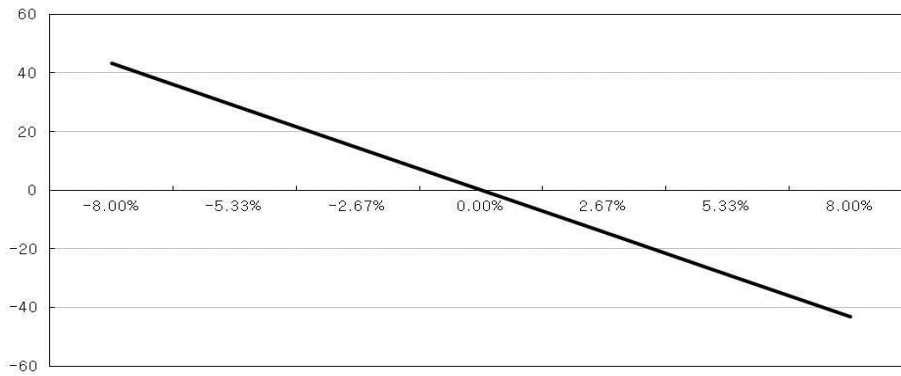
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	849	849	0	장내
누계	주가지수	선물	0	1,775	-1,775	장내
합계			0	1,775	-1,775	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

142

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

89

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

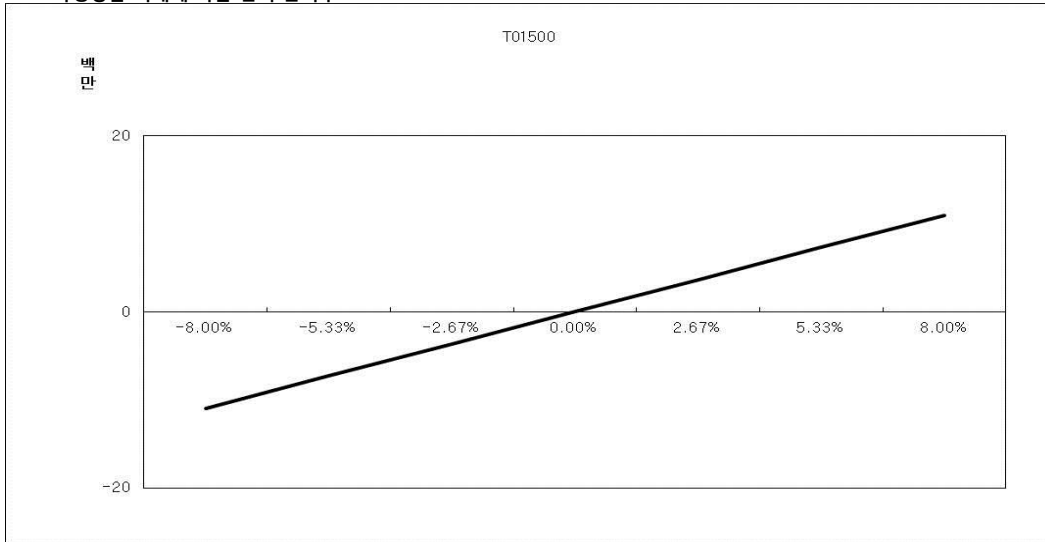
공시일: 2017-08-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	54	0	54	장외
누계	주가지수	스왑	0	280	-280	장외
합계			2,043	2,323	-280	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

8

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

76