

펀드명 : 트러스트인덱스알파(자)[주식-파생형]

공시일: 2017-08-31

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	464	0	464	장내
합계			464	0	464	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

23

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2017-08-31

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	0	1,780	-1,780	장내
합계			0	1,780	-1,780	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

143

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

89

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2017-08-31

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	39	-39	장외
누계	주가지수	스왑	0	314	-314	장외
합계			2,039	2,353	-314	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

8

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

78