

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

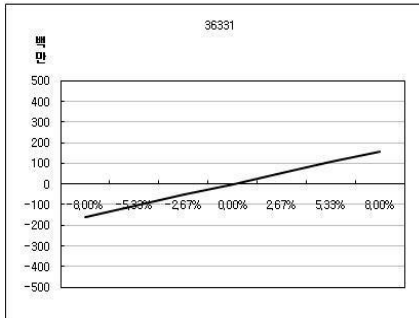
공시일: 2017-09-04

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 | 462 | 0 | 462 | 장내 |
| 합계 | | | 462 | 0 | 462 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

37

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

23

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

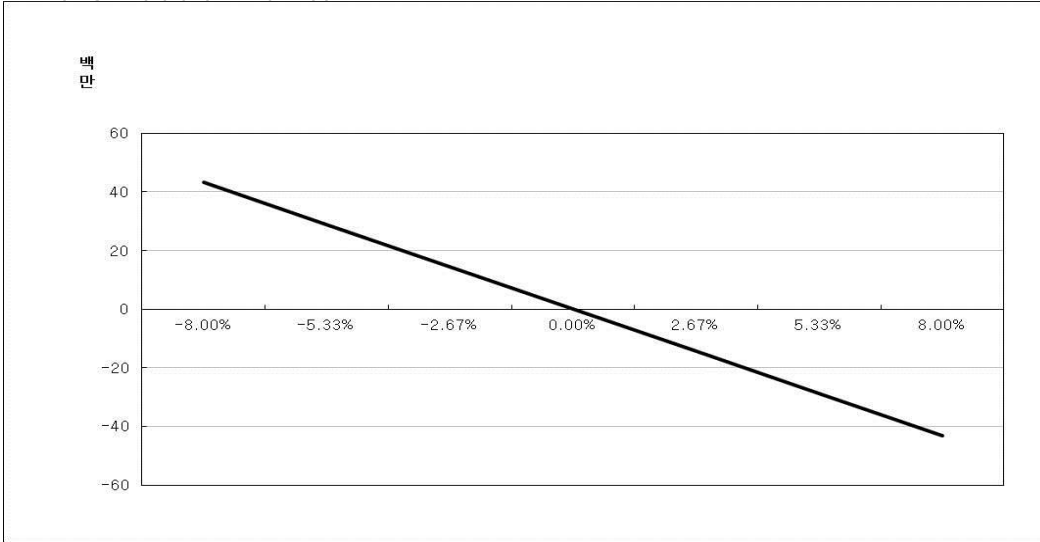
공시일: 2017-09-04

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 | 1,770 | -1,770 | 장내 |
| 합계 | | | 0 | 1,770 | -1,770 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

142

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

89

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2017-09-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 0 | 5 | -5 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 0 | 298 | -298 | 장외 |
| 합계 | | | 2,087 | 2,385 | -298 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

8

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

76