

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

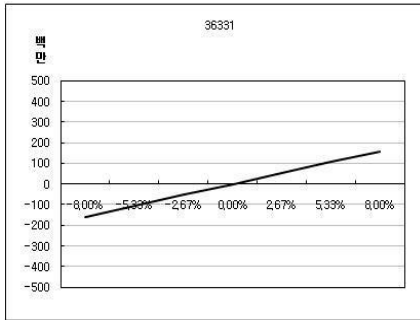
공시일: 2017-09-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	78	78	0	장내
누계	주가지수	선물	469	0	469	장내
합계			469	0	469	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

38

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

23

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

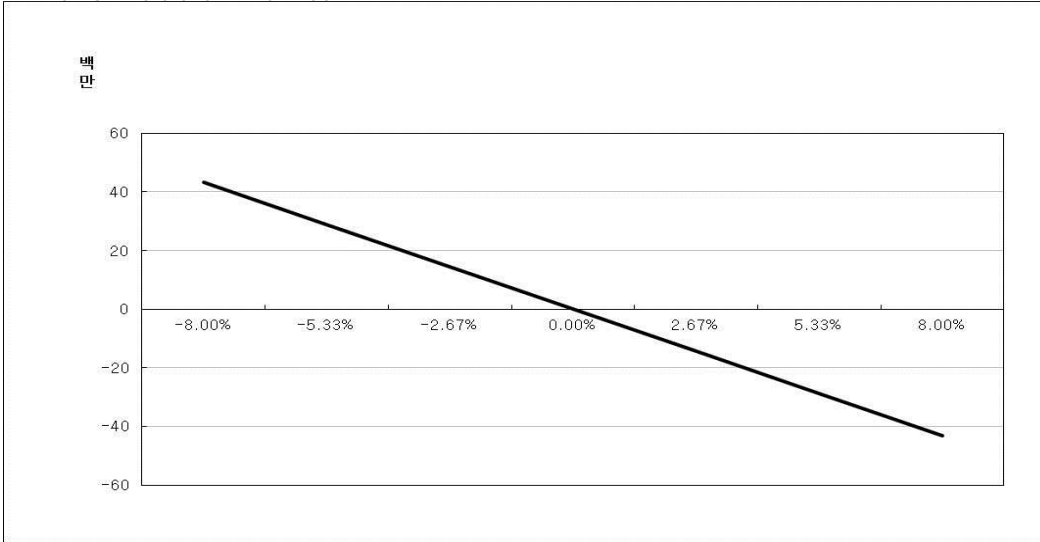
공시일: 2017-09-15

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	1,797	-1,797	장내
합계			0	1,797	-1,797	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

144

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

87

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

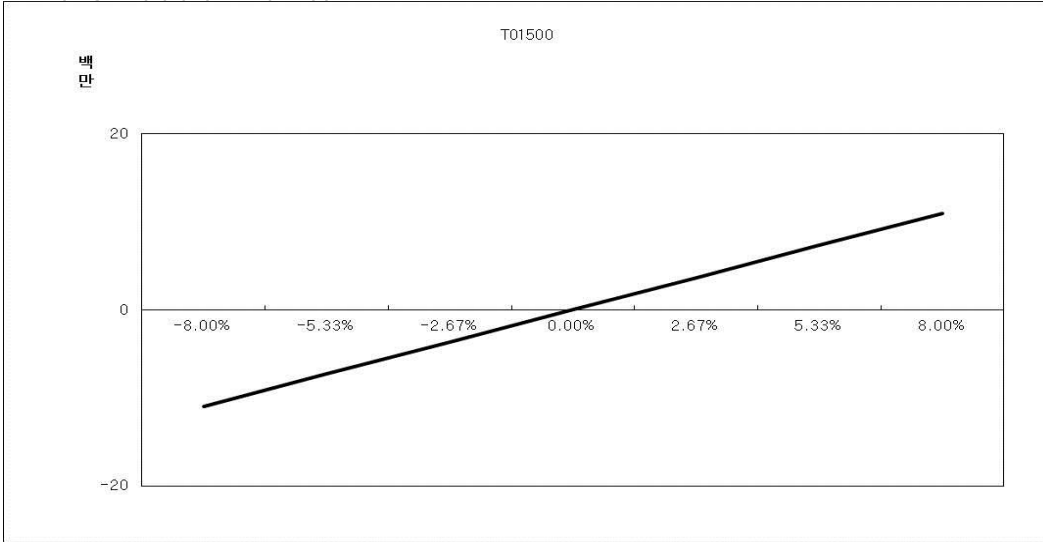
공시일: 2017-09-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	0	83	-83	장외
합계			2,264	2,347	-83	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

81