

펀드명 : 트러스트인덱스알파(자)[주식-파생형]

공시일: 2017-10-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,891	0	1,891	장내
누계	주가지수	선물	2,384	0	2,384	장내
합계			2,384	0	2,384	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

191

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

116

펀드명 : 트러스트정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2017-10-23

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	3,289	-3,289	장내
합계			0	3,289	-3,289	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

264

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

160

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2017-10-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	2	0	2	장외
누계	주가지수	스왑	0	371	-371	장외
합계			1,997	2,368	-371	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

110