

펀드명 : 트러스트인덱스알파(자)[주식-파생형]

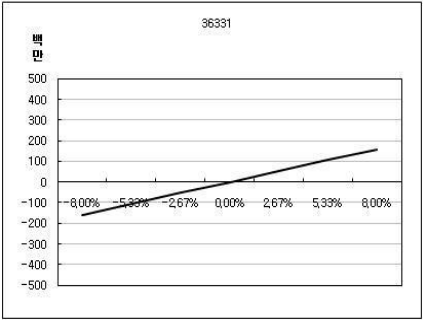
공시일: 2017-10-25

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	3,372	0	3,372	장내
합계			3,372	0	3,372	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

271

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

164

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2017-10-25

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	3,290	-3,290	장내
합계			0	3,290	-3,290	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

264

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

160

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2017-10-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	45	0	45	장외
누계	주가지수	스왑	0	301	-301	장외
합계			1,918	2,219	-301	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

108