

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

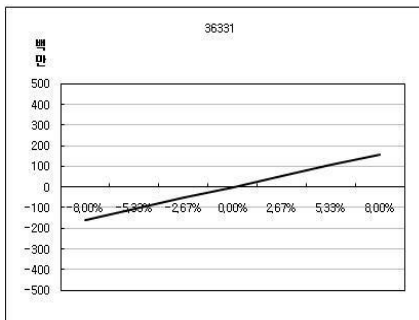
공시일: 2017-11-17

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	585	0	585	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	2	-2	장내
합계			585	2	583	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

47

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

0

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2017-11-17

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	3,344	-3,344	장내
합계			0	3,344	-3,344	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

268

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

153

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2017-11-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	40	0	40	장외
누계	주가지수	스왑	0	102	-102	장외
합계			2,182	2,283	-102	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

109