

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

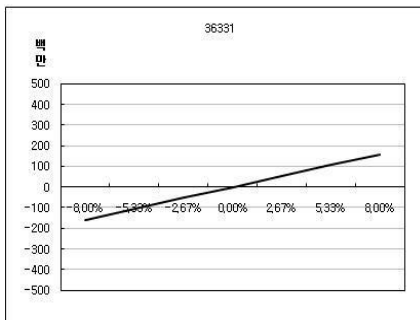
공시일: 2017-11-22

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	584	0	584	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	2	-2	장내
합계			584	2	582	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

47

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

0

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2017-11-22

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	3,335	-3,335	장내
합계			0	3,335	-3,335	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

267

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

152

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

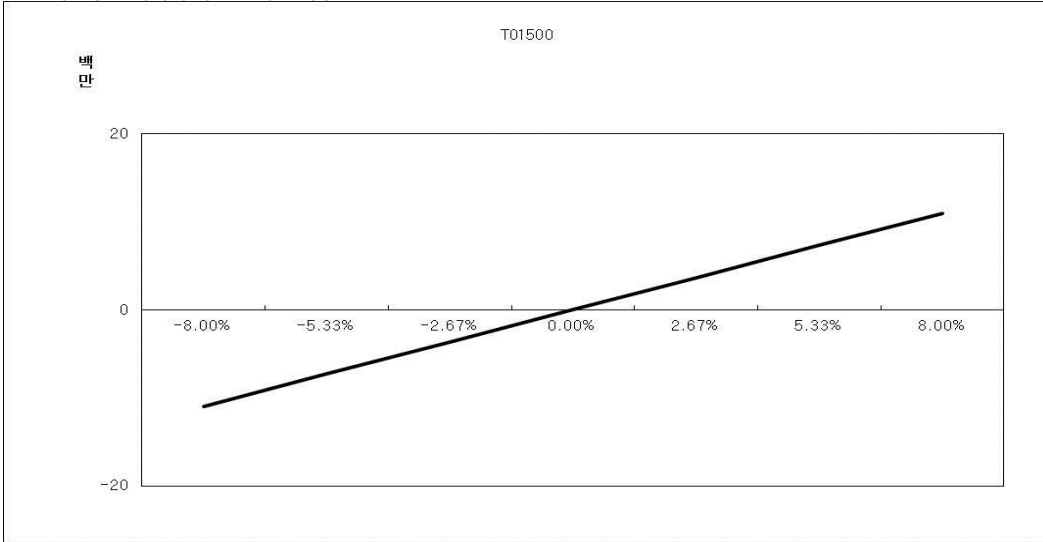
공시일: 2017-11-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	4	0	4	장외
누계	주가지수	스왑	0	170	-170	장외
합계			2,106	2,276	-170	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

110