펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

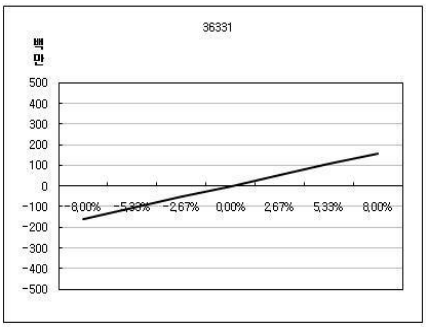
공시일: 2017-12-11

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	81	0	81	장내
합계			81	0	81	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동 6

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일) 4

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

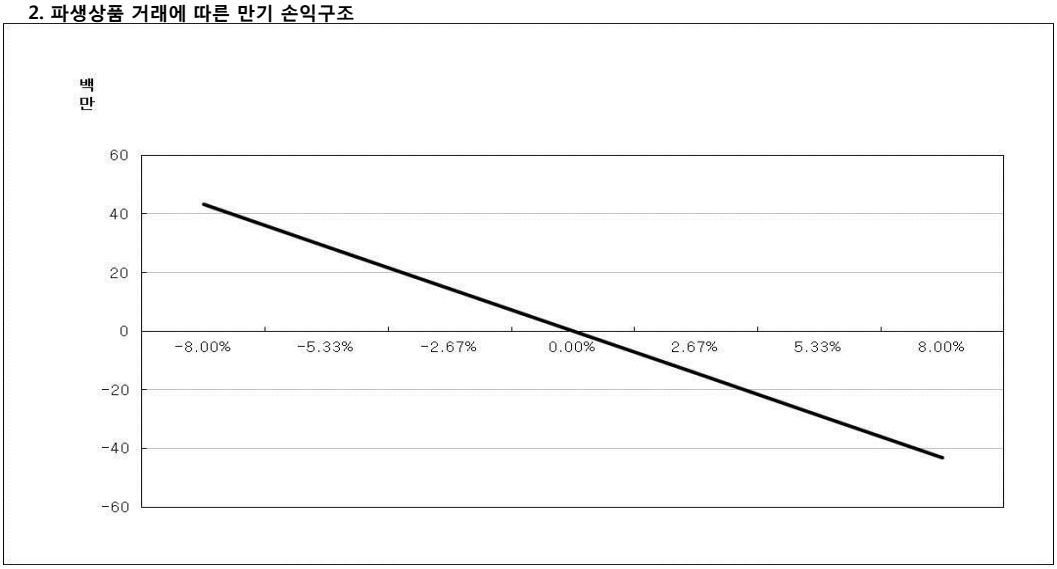
공시일: 2017-12-11

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	2,192	-2,192	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	257	-257	장내
합계			0	2,448	-2,448	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

175

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

109

트러스톤자산운용

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

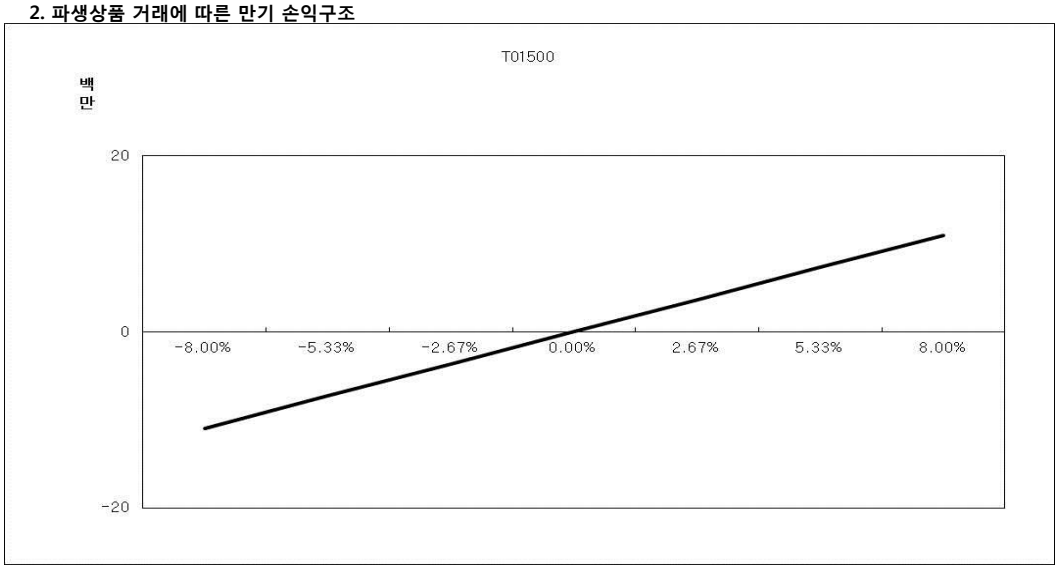
공시일: 2017-12-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	67	0	67	장외
누계	주가지수	스왑	0	91	-91	장외
합계			2,214	2,305	-91	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

116