

펀드명 : 트러스톤인덱스알파(자)[주식-파생형]

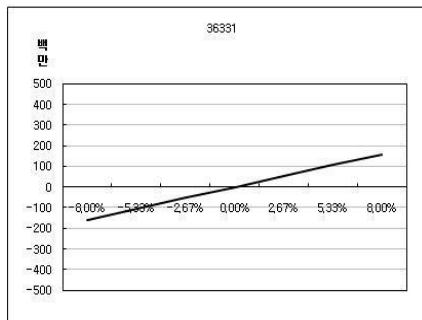
공시일: 2018-05-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	32	-32	장내
누계	주가지수	선물	238	0	238	장내
신규	유가증권	선물	1	5	-4	장내
누계	유가증권	선물	0	0	0	장내
합계			238	0	238	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

14

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

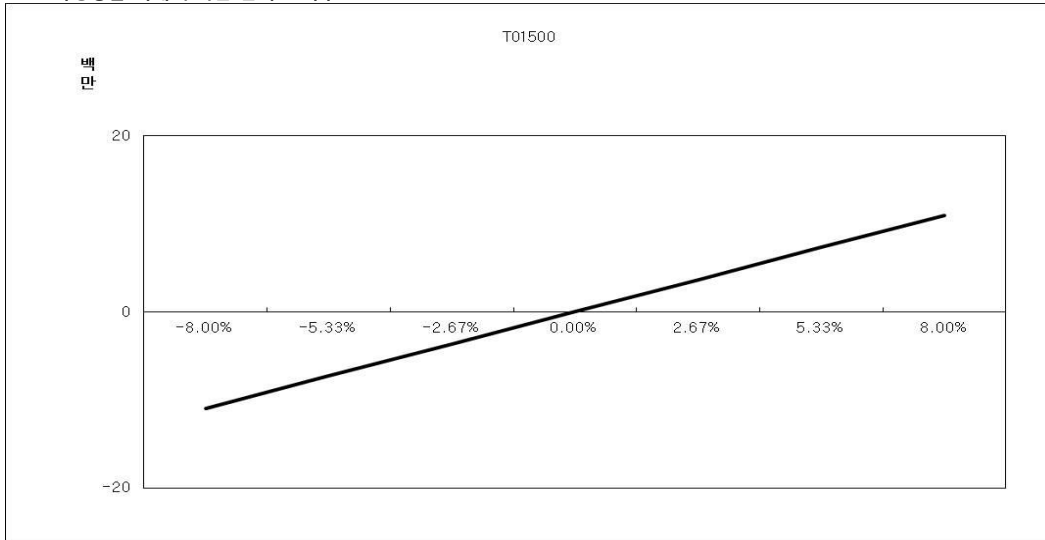
공시일: 2018-05-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	스왑	8	0	8	장외
누계	주가지수	스왑	177	0	177	장외
합계			3,074	2,897	177	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

100