

펀드명 : 트러스톤인덱스알파1(모)

공시일: 2011-06-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,246	-1,246	장내
누계	주가지수	선물	1,246	0	1,246	장내
합계			1,246	0	1,246	장내

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

트러스톤인덱스알파1(모)	100
---------------	-----

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

트러스톤인덱스알파1(모)	89
---------------	----