

펀드명 : 트러스톤인덱스알파1(모)

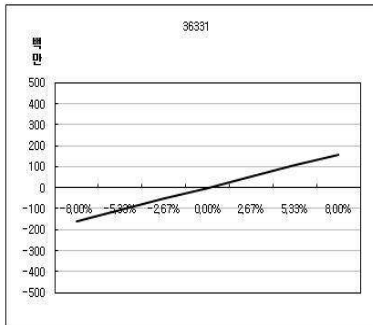
공시일: 2012-03-27

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   | 4,813 | 0     | 4,813     | 장내 |
| 합계 |      |      | 4,813 | 0     | 4,813     | 장내 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

|               |     |
|---------------|-----|
| 트러스톤인덱스알파1(모) | 389 |
|---------------|-----|

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

|               |     |
|---------------|-----|
| 트러스톤인덱스알파1(모) | 613 |
|---------------|-----|