

펀드명 : 트러스톤인덱스알파1(모)

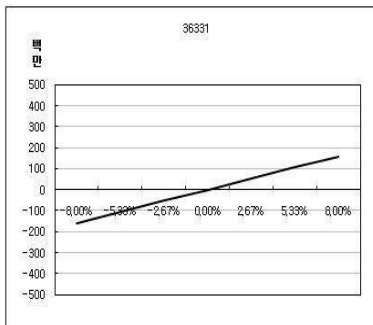
공시일: 2012-05-08

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 | 4,156 | 0 | 4,156 | 장내 |
| 합계 | | | 4,156 | 0 | 4,156 | 장내 |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

| | |
|---------------|-----|
| 트러스톤인덱스알파1(모) | 332 |
|---------------|-----|

4. 최대손실금액 (VaR: 99%, 10일)

(단위: 백만원)

| | |
|---------------|-----|
| 트러스톤인덱스알파1(모) | 523 |
|---------------|-----|