

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-03-19

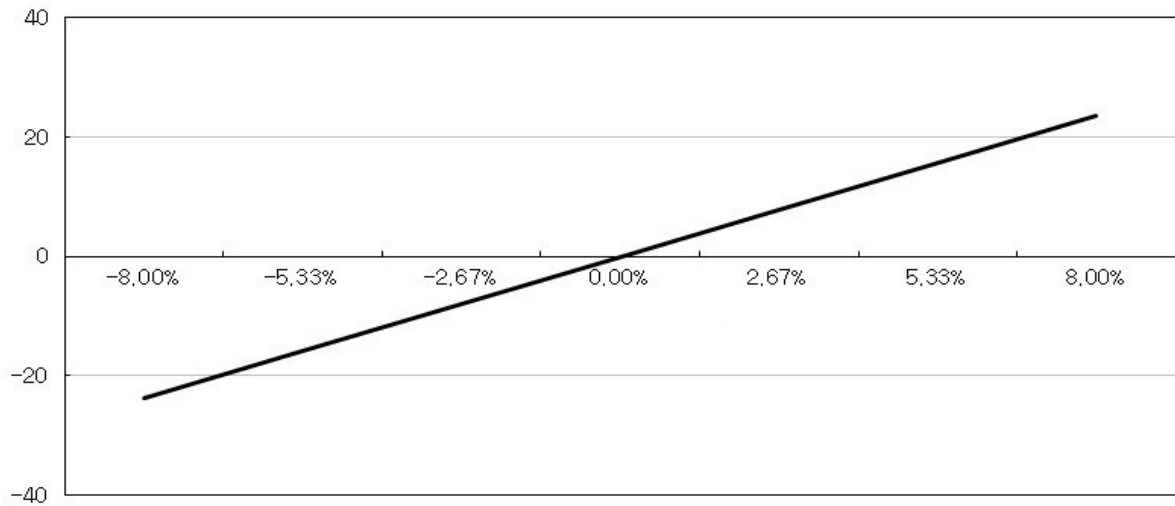
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	108	0	108	장내
신규	주식	주식	1	3	-2	장내
누계	주식	주식	5,429	0	5,429	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	36	0	36	장내
합계			5,574	0	5,574	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

8

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

490

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

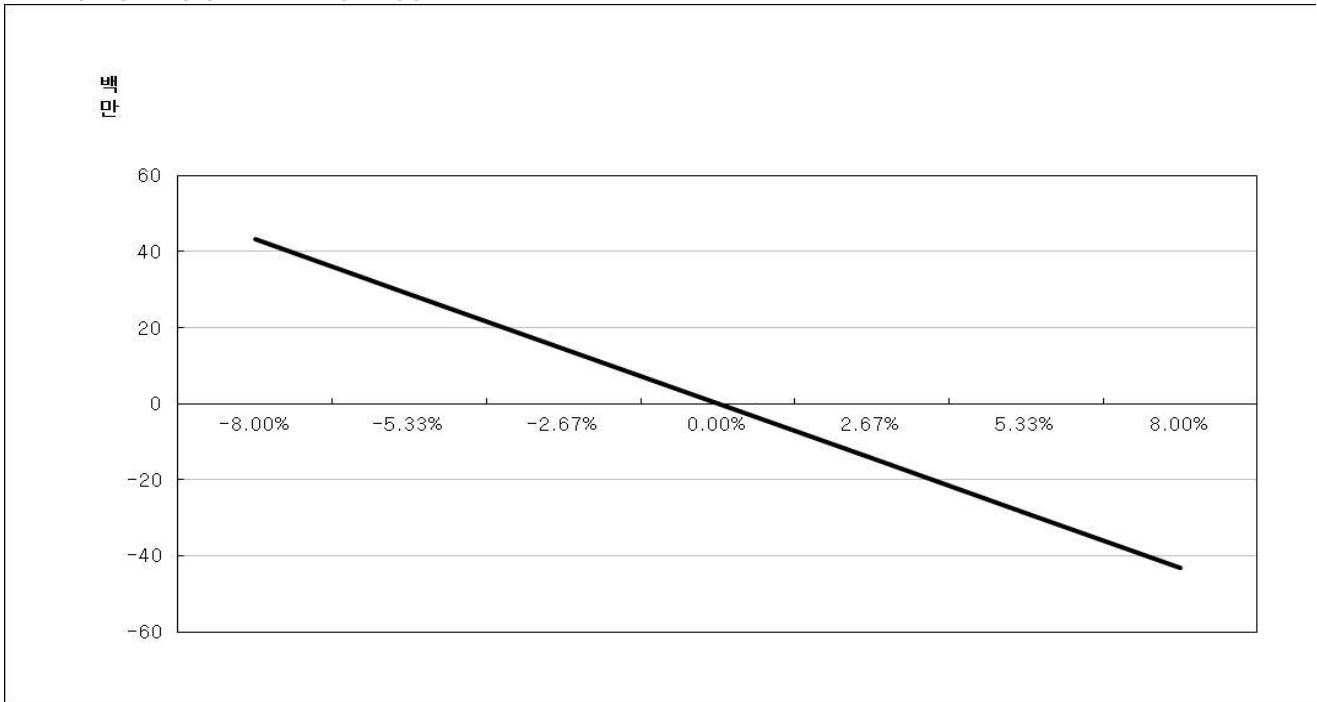
공시일: 2020-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	199	41	158	장내
누계	주식	주식	6,512	945	5,567	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	260	-260	장내
합계			6,512	1,205	5,306	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

20

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

578

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

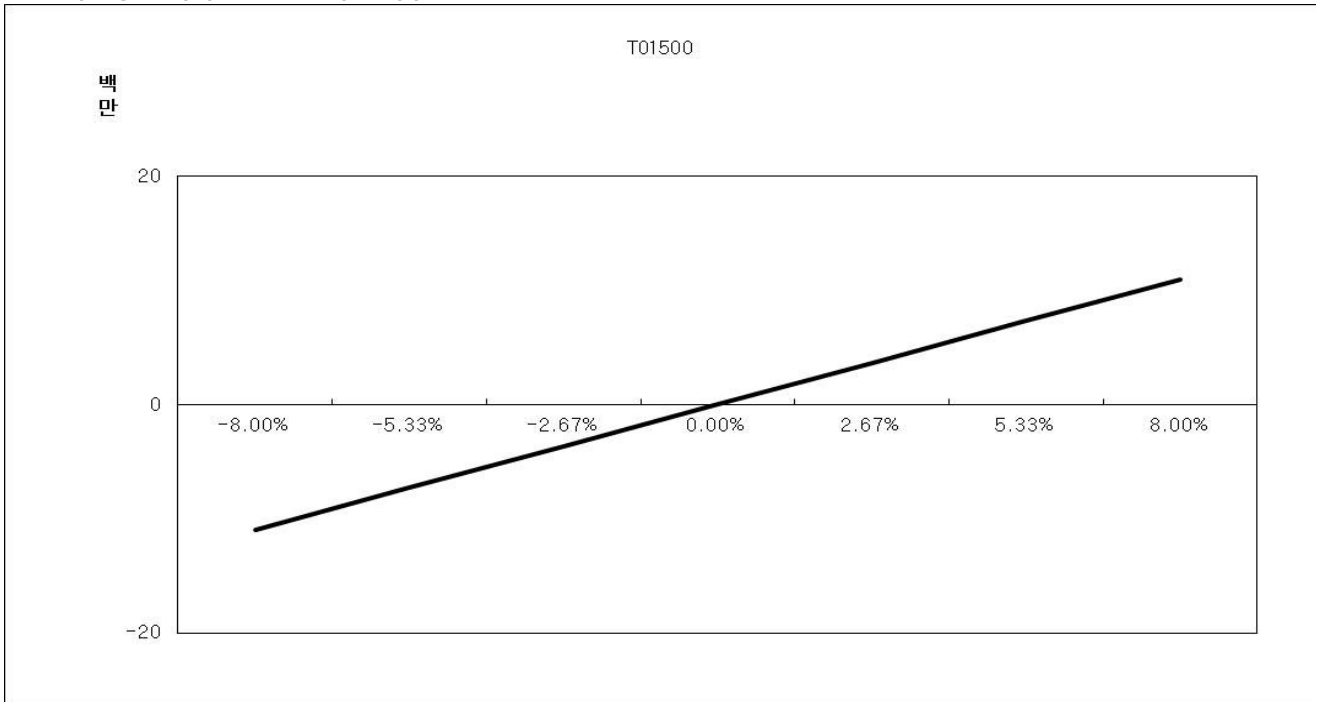
공시일: 2020-03-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	694	0	694	장내
신규	주가지수	스왑	117	125	-8	장외
누계	주가지수	스왑	48,373	3,358	45,015	장외
합계			49,066	3,358	45,709	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,481