

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-05-14

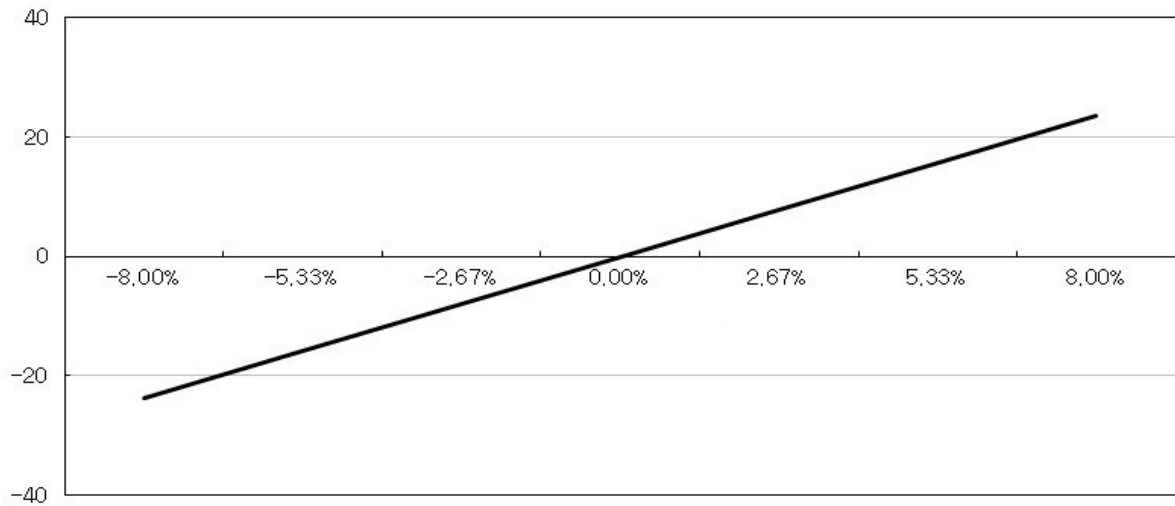
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	4,477	0	4,477	장내
신규	주식	주식	0	1	-1	장내
누계	주식	주식	2,032	0	2,032	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	74	0	74	장내
합계			6,583	0	6,583	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

358

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

743

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

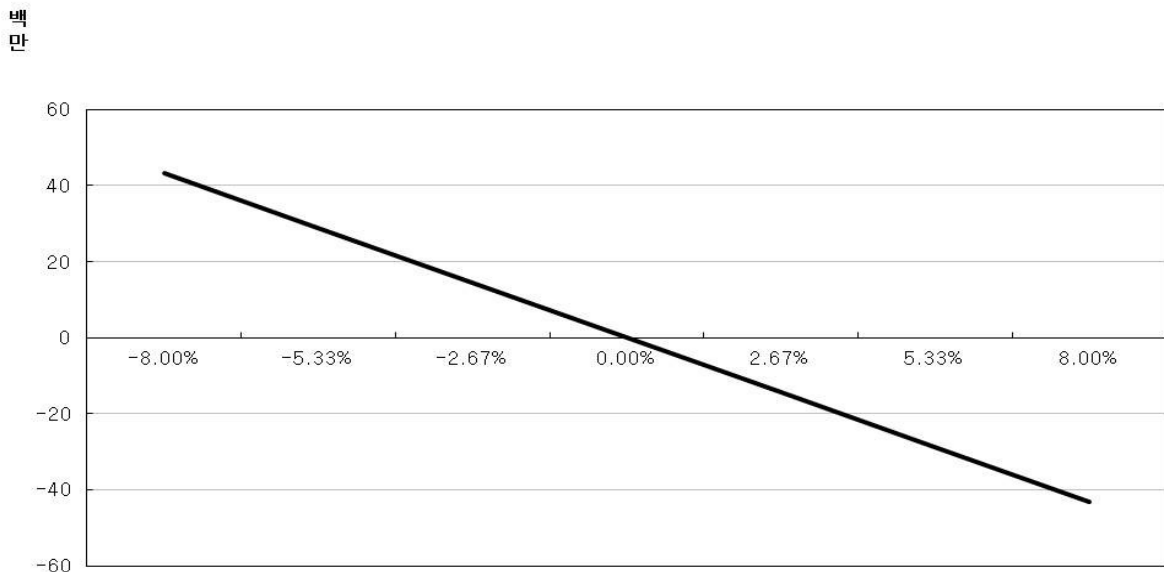
공시일: 2020-05-14

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	0	704	-704	장내
신규	주식	주식	93	157	-65	장내
누계	주식	주식	5,183	871	4,313	장내
신규	유가증권	선물	750	750	0	장내
누계	유가증권	선물	0	931	-931	장내
합계			5,183	2,505	2,678	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

56

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

382

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

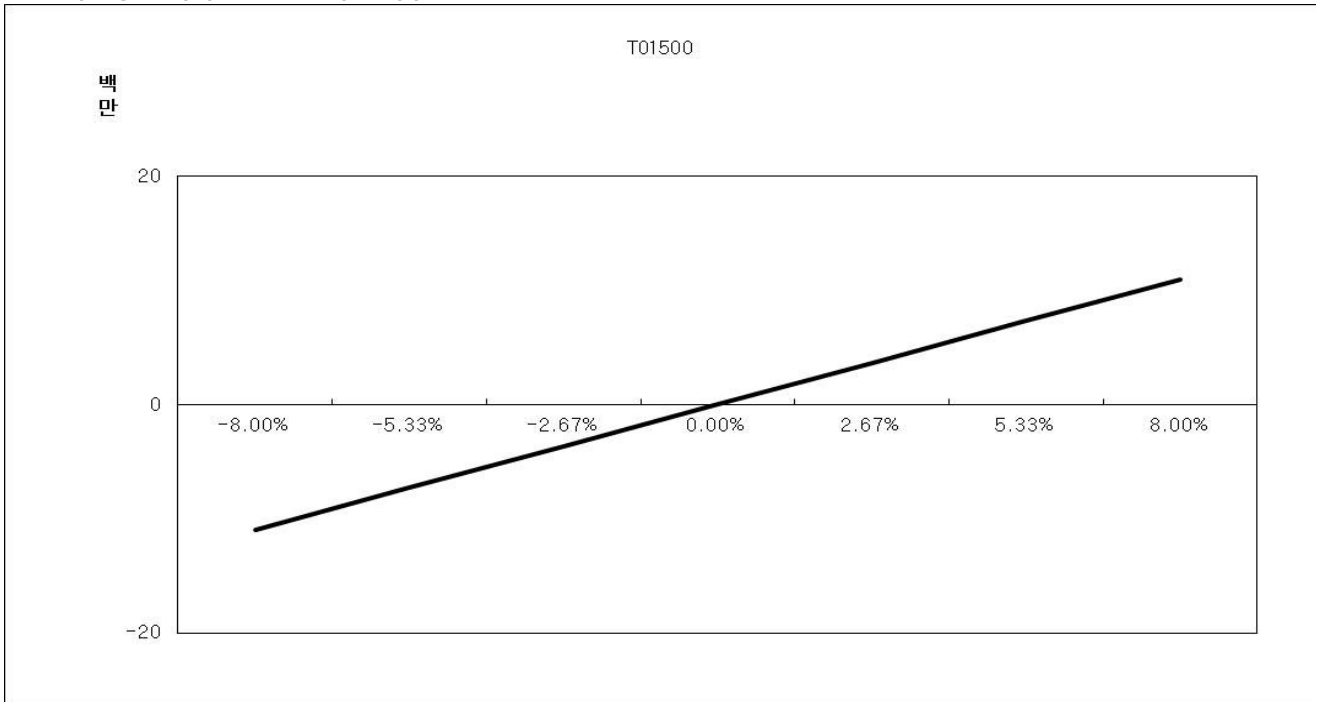
공시일: 2020-05-14

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	702	0	702	장내
신규	주가지수	스왑	4,111	0	4,111	장외
누계	주가지수	스왑	46,819	4,178	42,641	장외
합계			47,521	4,178	43,343	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,750