

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2019-02-12

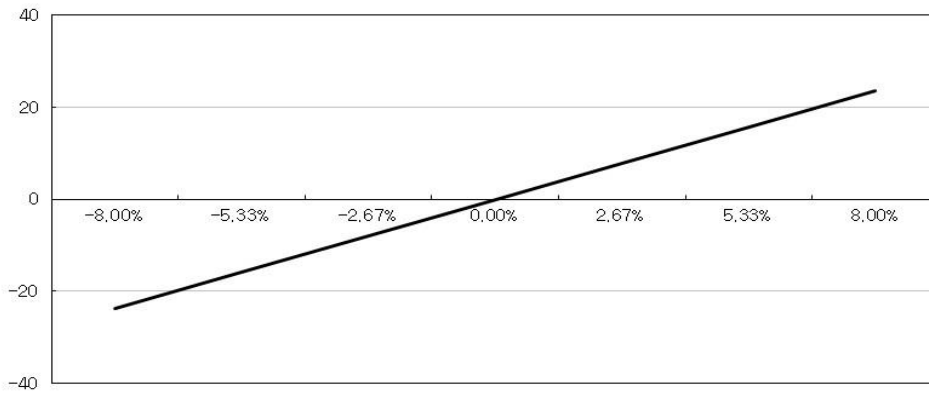
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	5,034	0	5,034	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	141	0	141	장내
합계			5,176	0	5,176	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,618

펀드명 : 트러스트정정당당[주식-파생형](모)

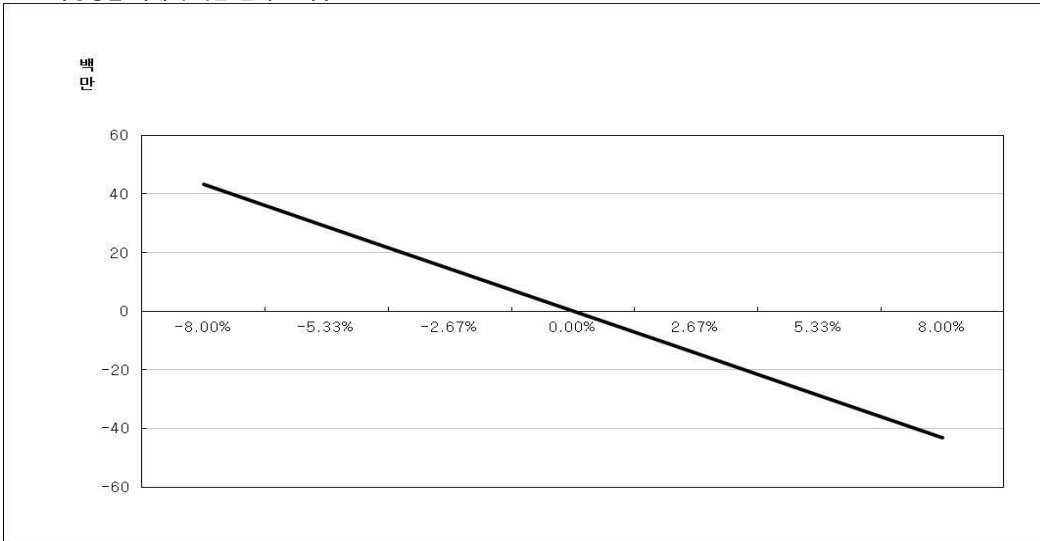
공시일: 2019-02-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	121	47	73	장내
누계	주식	주식	3,209	703	2,506	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	180	-180	장내
합계			3,209	883	2,326	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

351

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

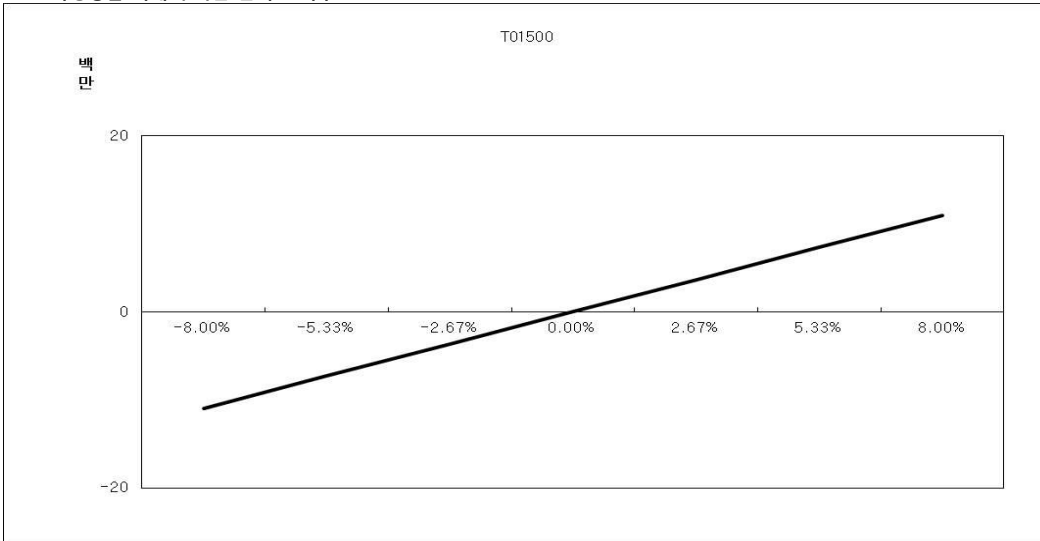
공시일: 2019-02-12

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	943	0	943	장내
신규	주가지수	스왑	0	141	-141	장외
누계	주가지수	스왑	18,518	0	18,518	장외
합계			22,203	2,743	19,460	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

770