

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2019-02-15

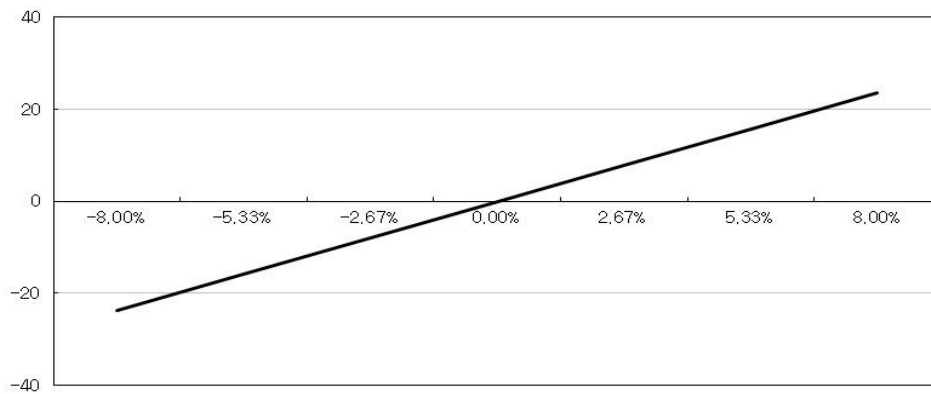
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	32	0	32	장내
누계	주식	주식	5,180	0	5,180	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	144	0	144	장내
합계			5,325	0	5,325	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,751

펀드명 : 트러스트정정당당[주식-파생형](모)

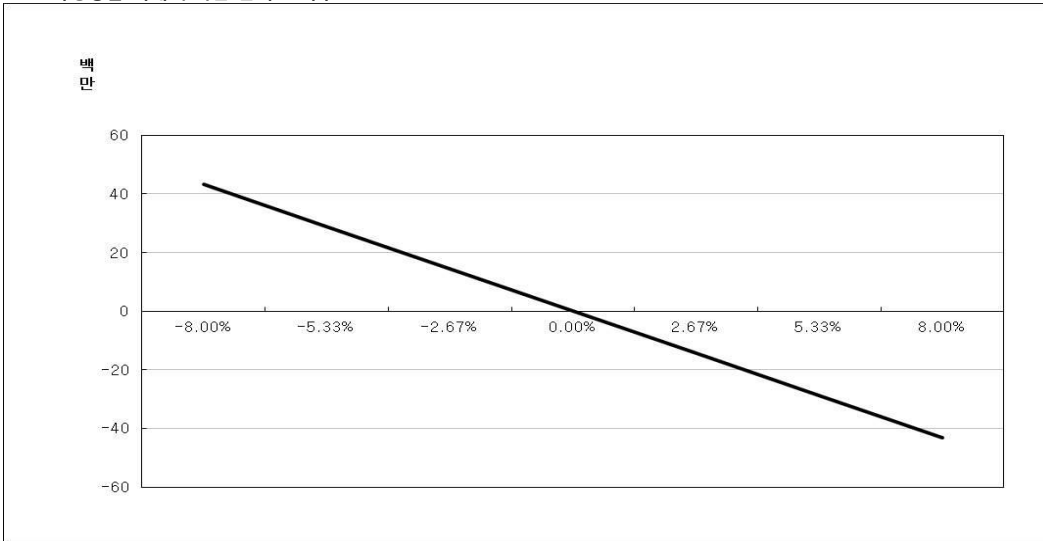
공시일: 2019-02-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	77	51	27	장내
누계	주식	주식	3,219	699	2,520	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	190	-190	장내
합계			3,219	889	2,330	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

311

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

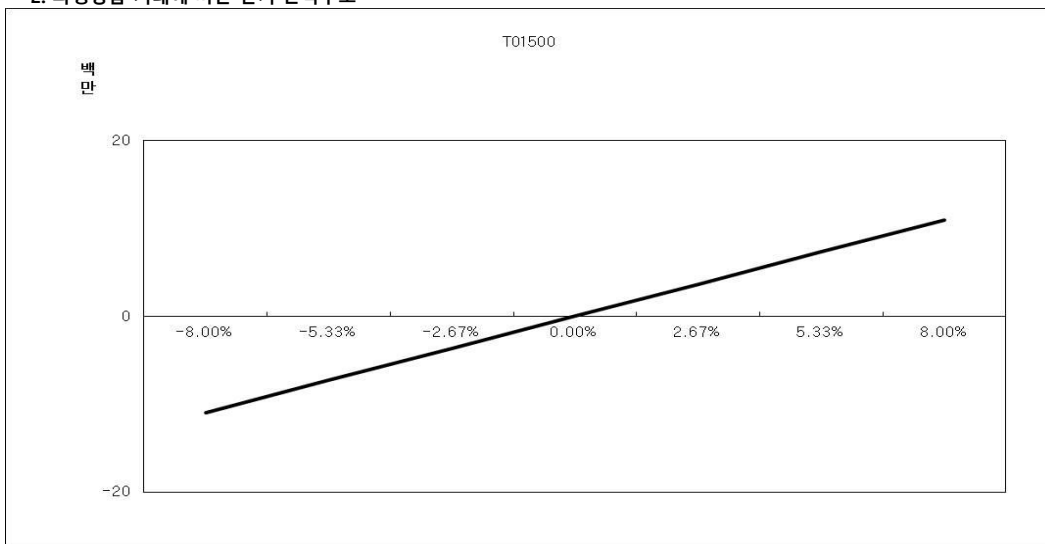
공시일: 2019-02-15

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	961	0	961	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	0	0	장외
신규	주가지수	스왑	0	37	-37	장외
누계	주가지수	스왑	18,487	0	18,487	장외
합계			22,348	2,900	19,448	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

771