

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2019-02-22

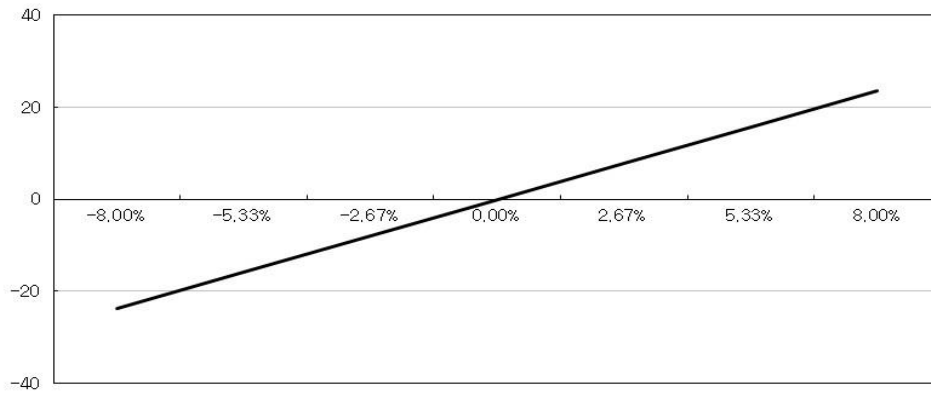
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	5,181	0	5,181	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)

2,712

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

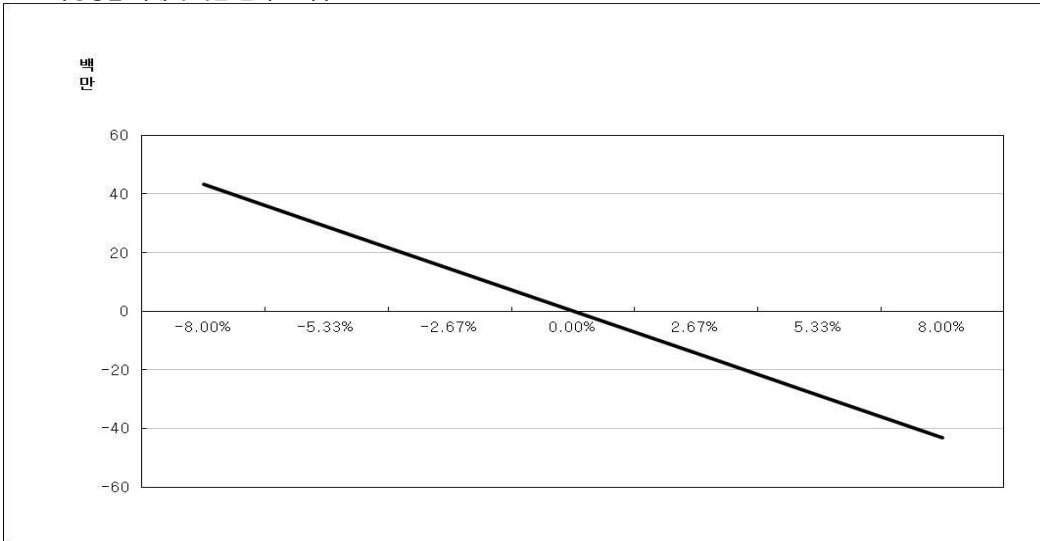
공시일: 2019-02-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	32	216	-184	장내
누계	주식	주식	5,303	1,473	3,829	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	423	-423	장내
합계			5,303	1,896	3,407	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

467

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

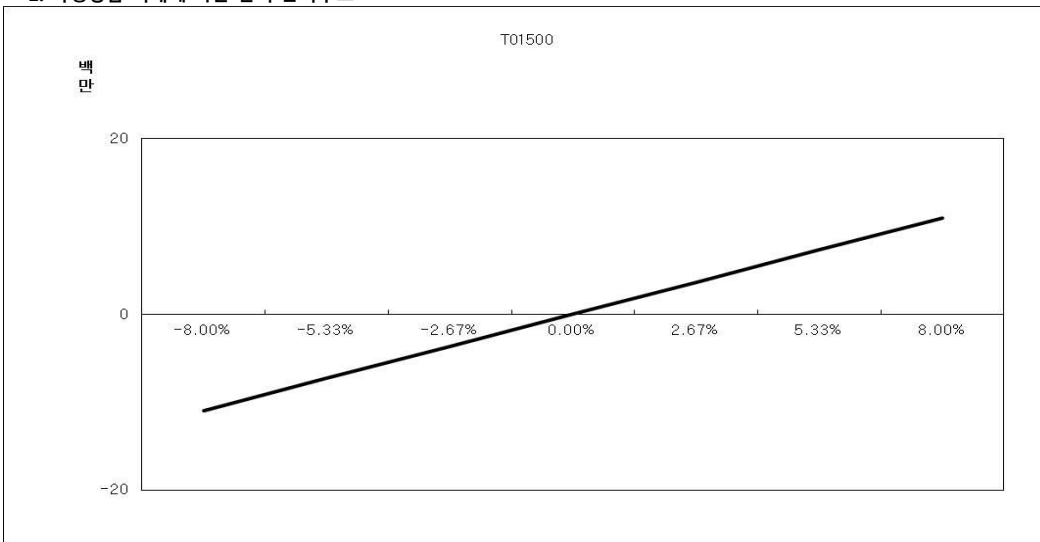
공시일: 2019-02-22

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	983	0	983	장내
신규	통화	선도	0	0	0	장외
누계	통화	선도	0	0	0	장외
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	18,441	0	18,441	장외
합계			22,434	3,010	19,424	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

764