

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2019-02-28

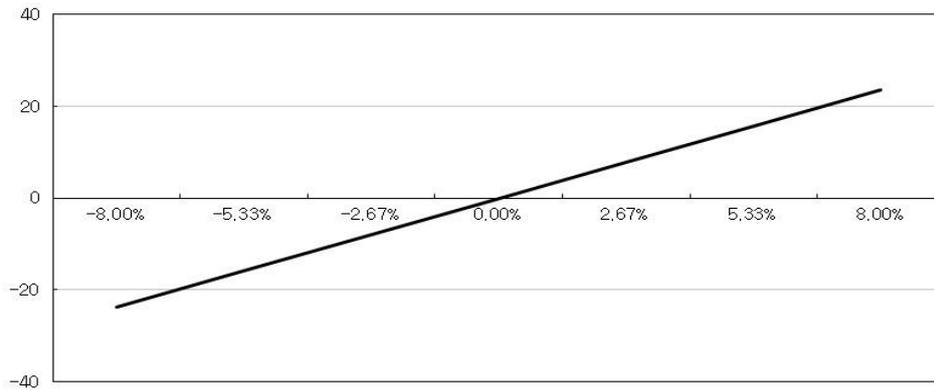
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	5,186	0	5,186	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	144	0	144	장내
합계			5,330	0	5,330	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,699

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

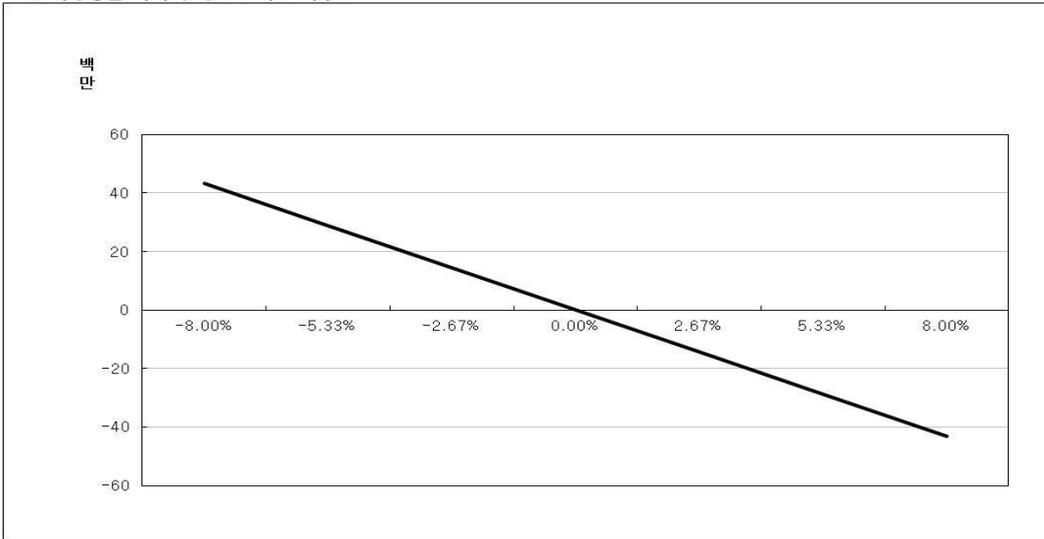
공시일: 2019-02-28

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	22	-22	장내
누계	주식	주식	5,426	1,581	3,846	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	421	-421	장내
합계			5,426	2,001	3,425	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

477

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

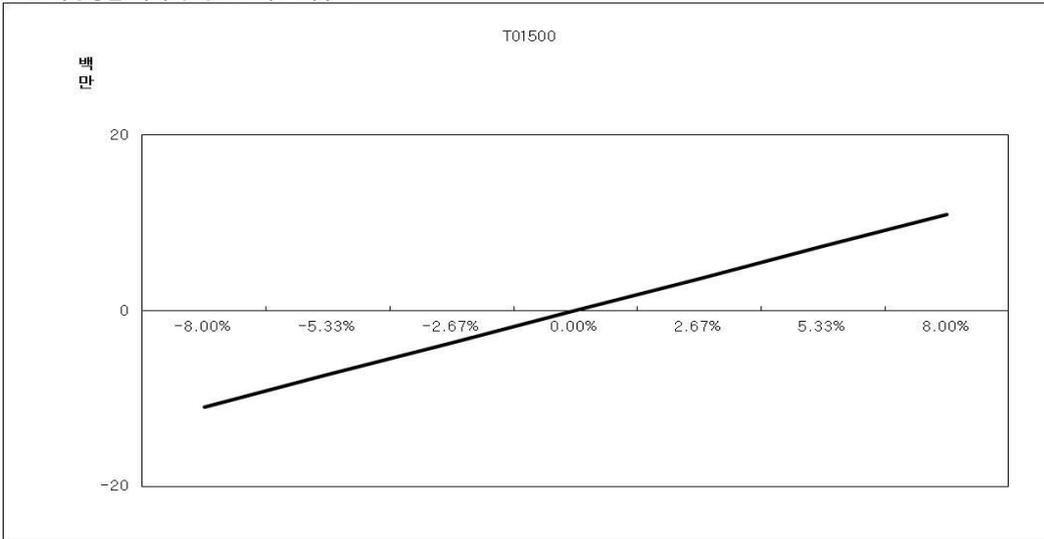
공시일: 2019-02-28

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	987	0	987	장내
신규	주가지수	스왑	0	30	-30	장외
누계	주가지수	스왑	18,380	0	18,380	장외
합계			22,355	2,988	19,367	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

751