

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2019-04-01

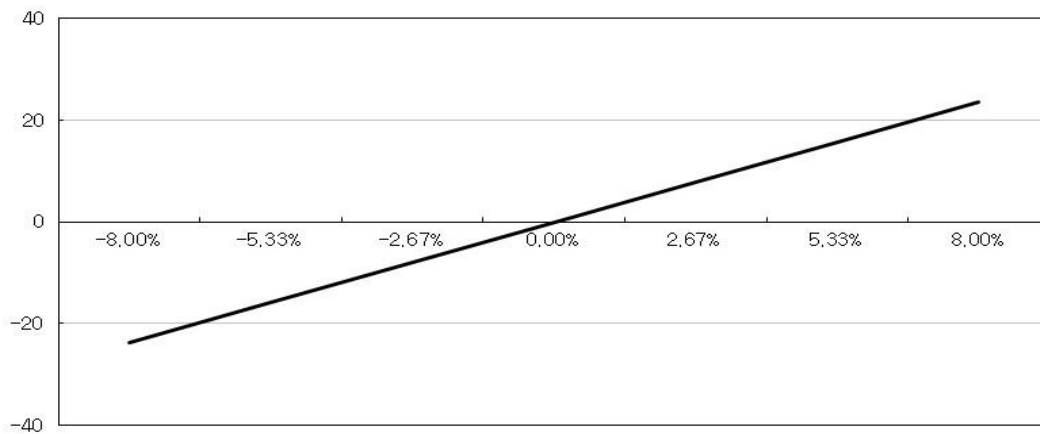
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	4,889	0	4,889	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	138	0	138	장내
합계			5,027	0	5,027	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,561

펀드명 : 트러스트정정당당[주식-파생형](모)

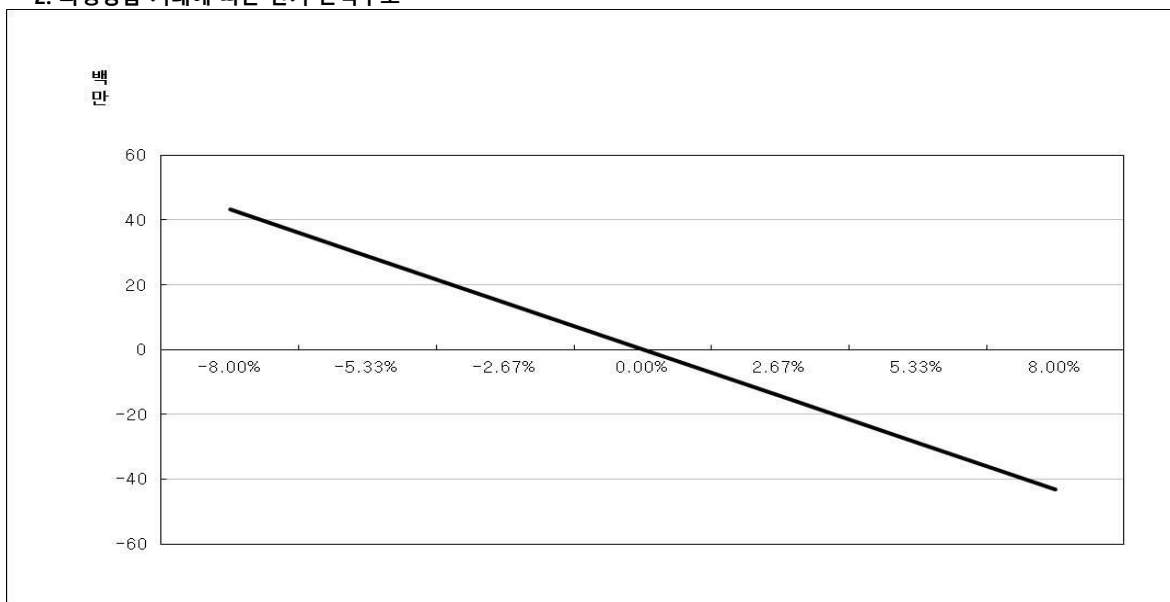
공시일: 2019-04-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	229	93	136	장내
누계	주식	주식	7,255	1,986	5,269	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	281	-281	장내
합계			7,255	2,267	4,988	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

579

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

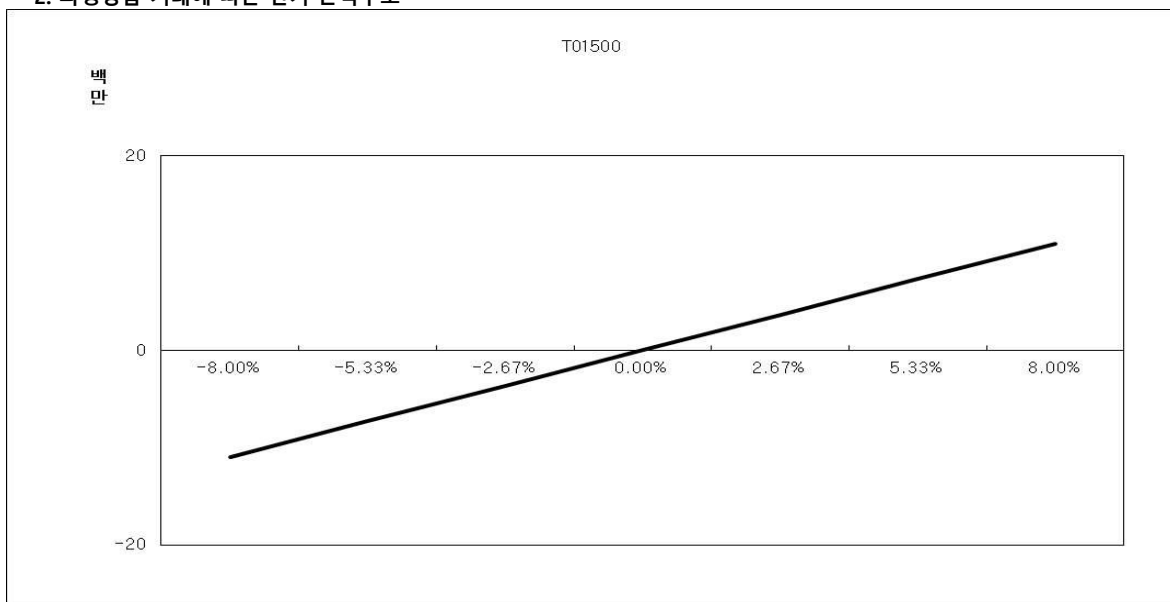
공시일: 2019-04-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	76	0	76	장내
누계	주식	주식	983	0	983	장내
신규	주가지수	스왑	0	105	-105	장외
누계	주가지수	스왑	18,455	0	18,455	장외
합계			23,361	3,922	19,438	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

723