

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-02-26

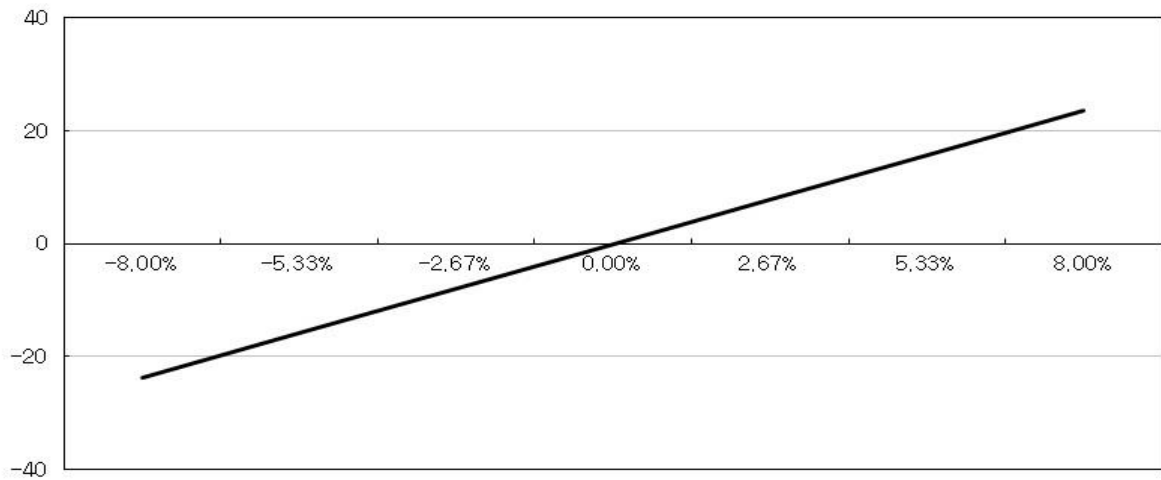
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	7,152	0	7,152	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	71	0	71	장내
신규	유가증권	선물	0	12	-12	장내
누계	유가증권	선물	46	0	46	장내
합계			7,269	0	7,269	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

546

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

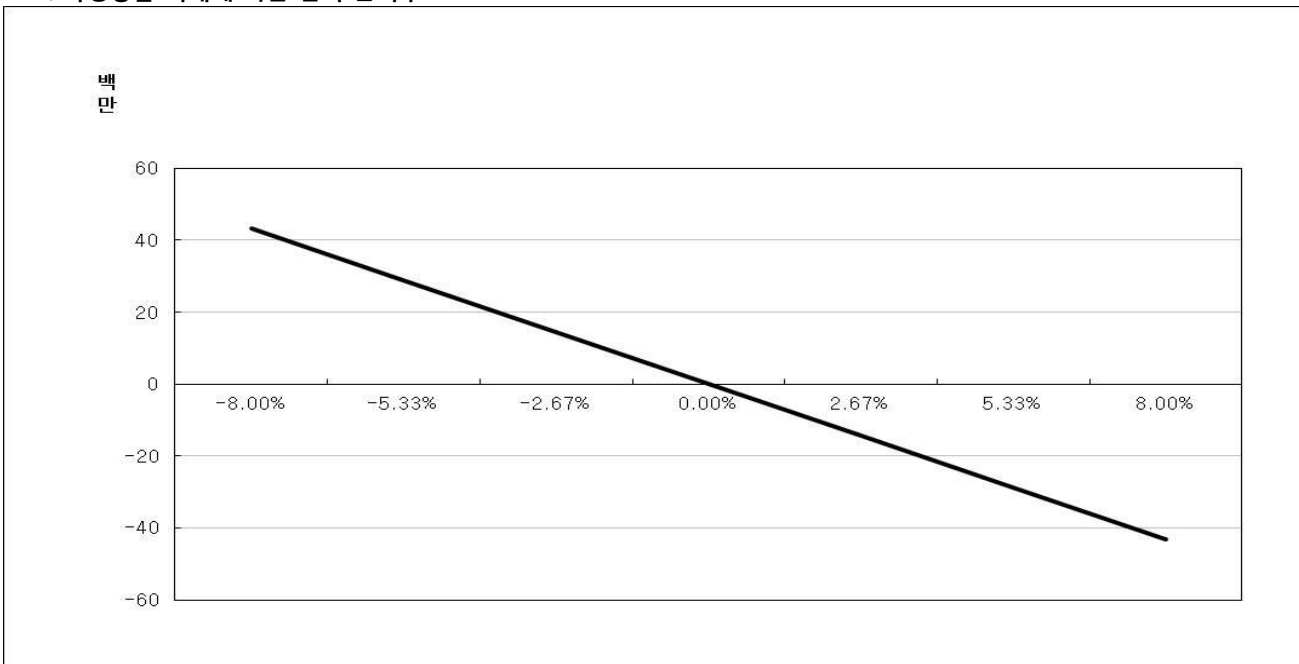
공시일: 2020-02-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	427	0	427	장내
누계	주식	주식	7,720	1,864	5,855	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	0	142	-142	장내
합계			7,720	2,007	5,713	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

521

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

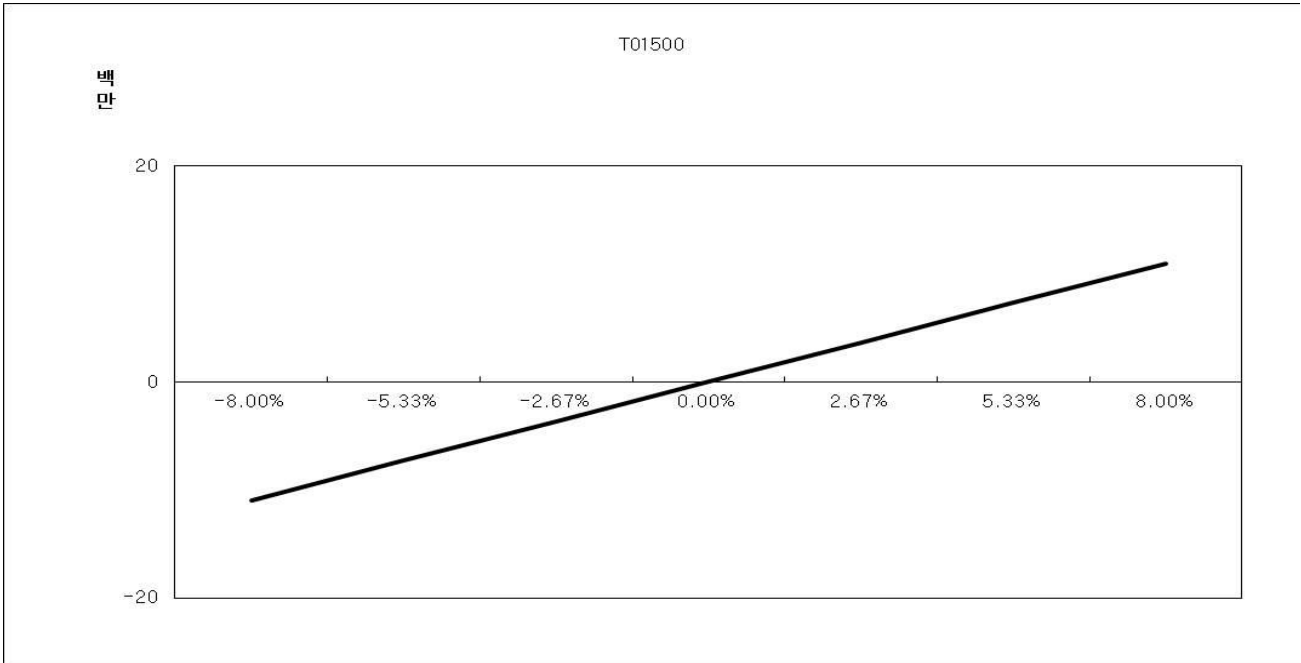
공시일: 2020-02-26

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	736	0	736	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	11,119	0	11,119	장외
합계			16,078	4,222	11,855	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

311