

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-03-23

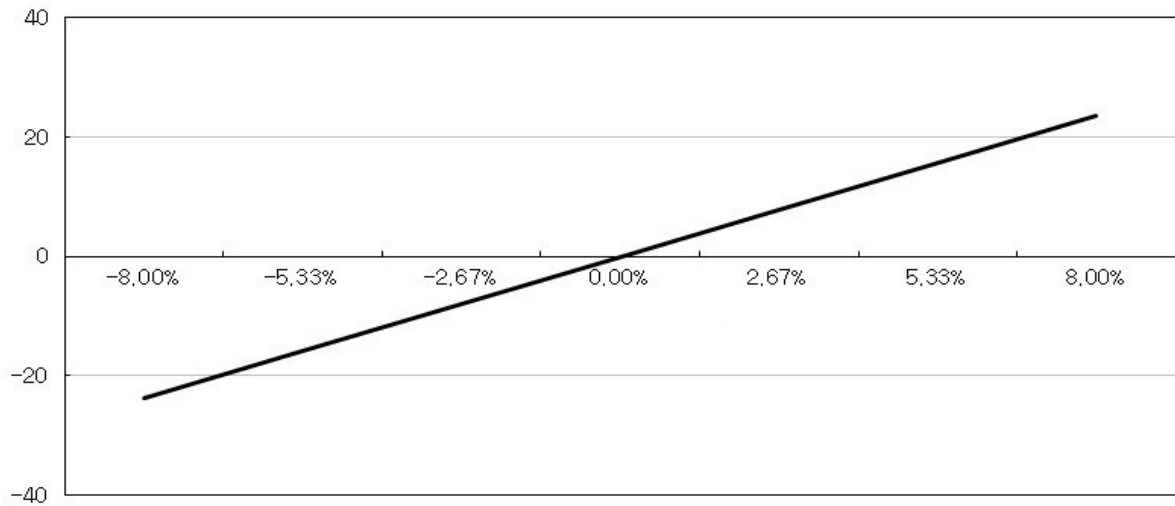
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	107	0	107	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	5,372	0	5,372	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	36	0	36	장내
합계			5,516	0	5,516	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

556

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

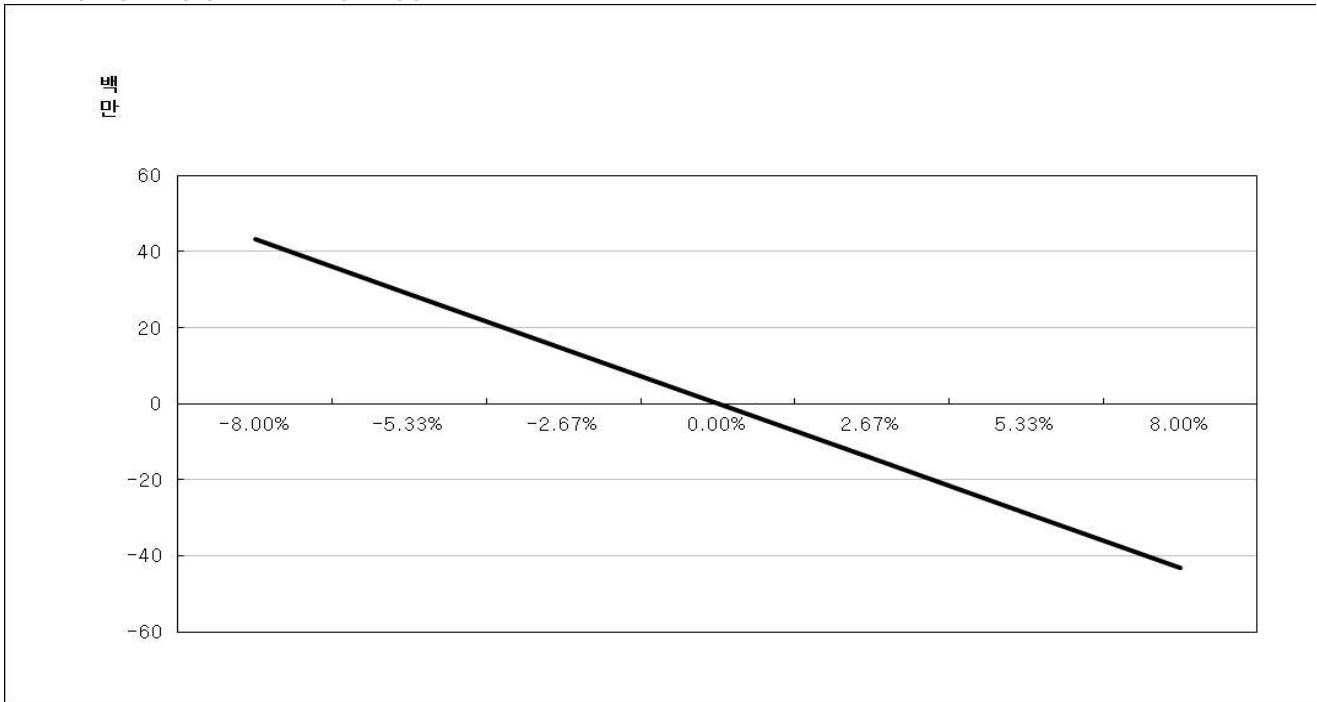
공시일: 2020-03-23

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	6,655	745	5,910	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	299	-299	장내
합계			6,655	1,044	5,611	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

24

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

727

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

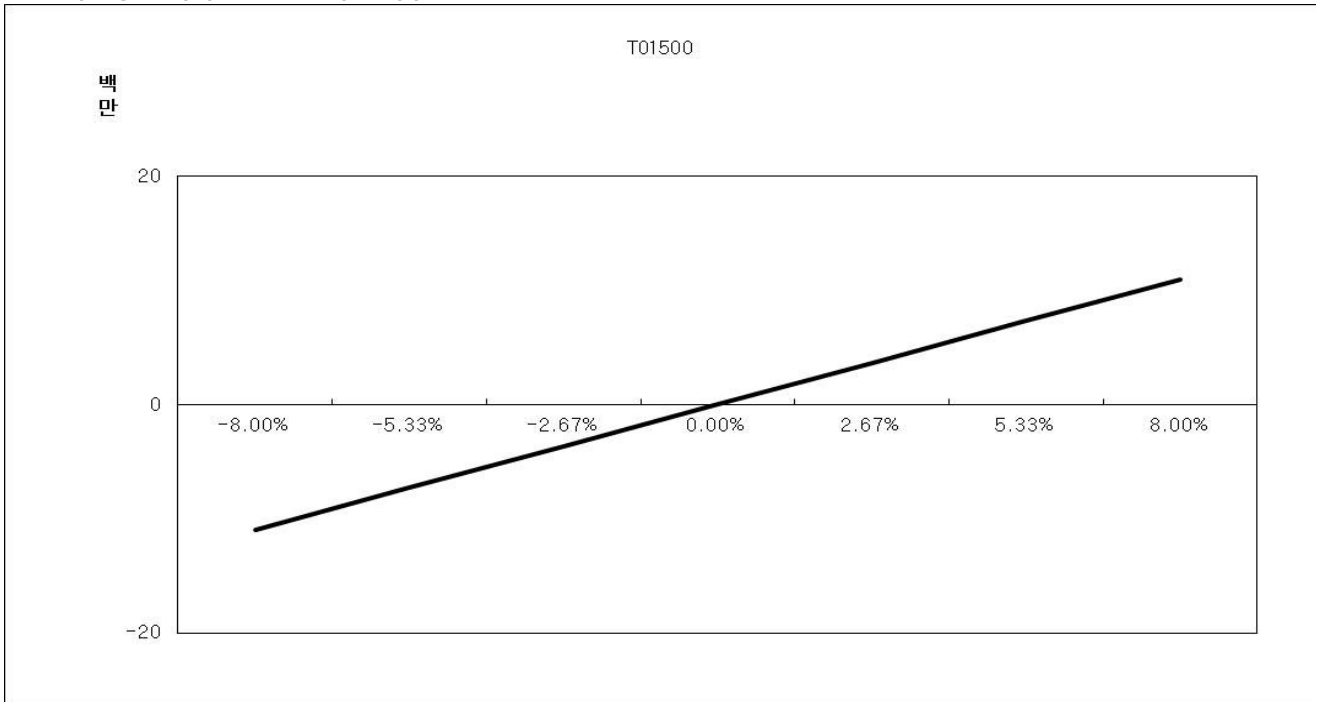
공시일: 2020-03-23

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	680	0	680	장내
신규	주가지수	스왑	54	61	-7	장외
누계	주가지수	스왑	48,488	3,428	45,060	장외
합계			49,168	3,428	45,739	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

13

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,738