

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-03-30

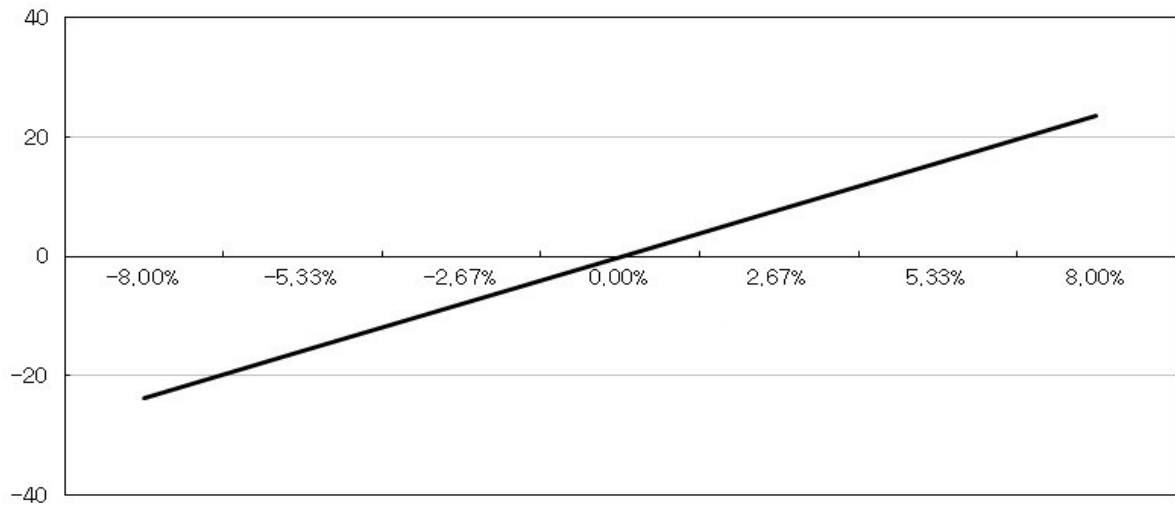
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	3,624	0	3,624	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	2,462	0	2,462	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	39	0	39	장내
합계			6,124	0	6,124	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

289

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

642

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

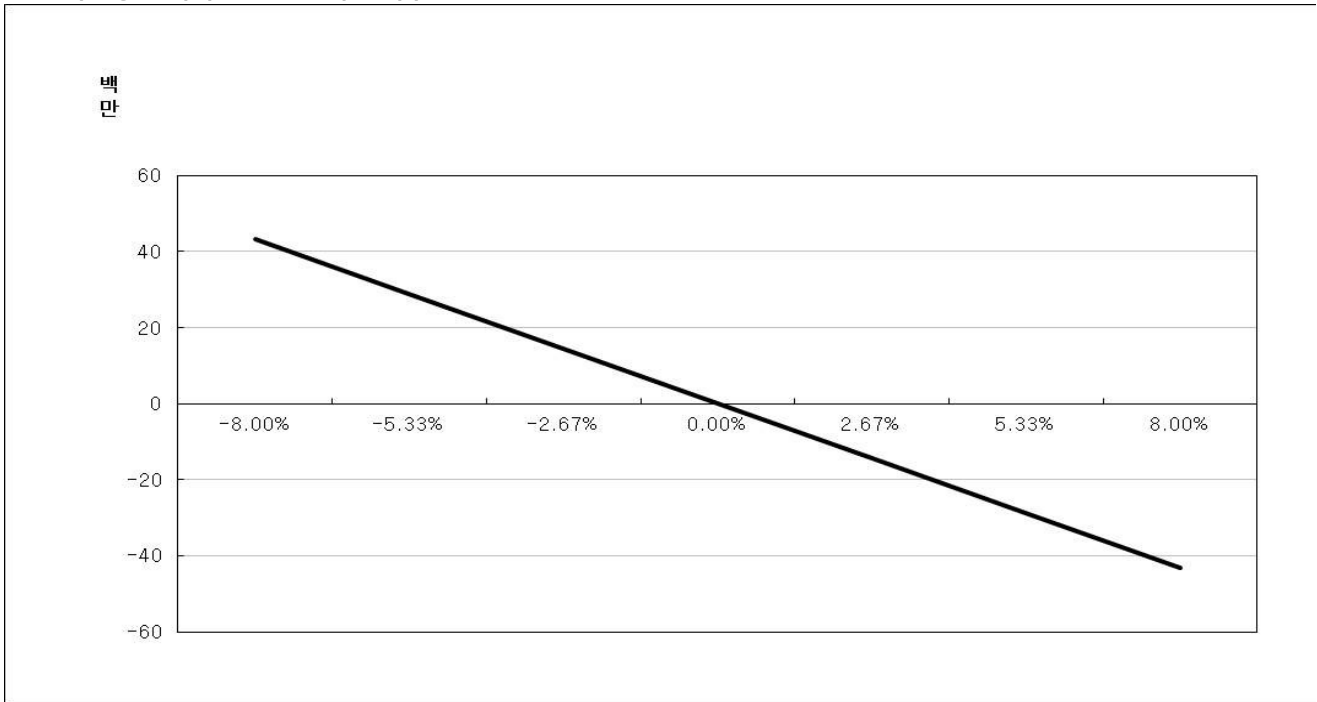
공시일: 2020-03-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	475	-475	장내
누계	주식	주식	6,172	752	5,420	장내
신규	유가증권	선물	83	0	83	장내
누계	유가증권	선물	0	365	-365	장내
합계			6,172	1,117	5,055	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

29

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

762

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

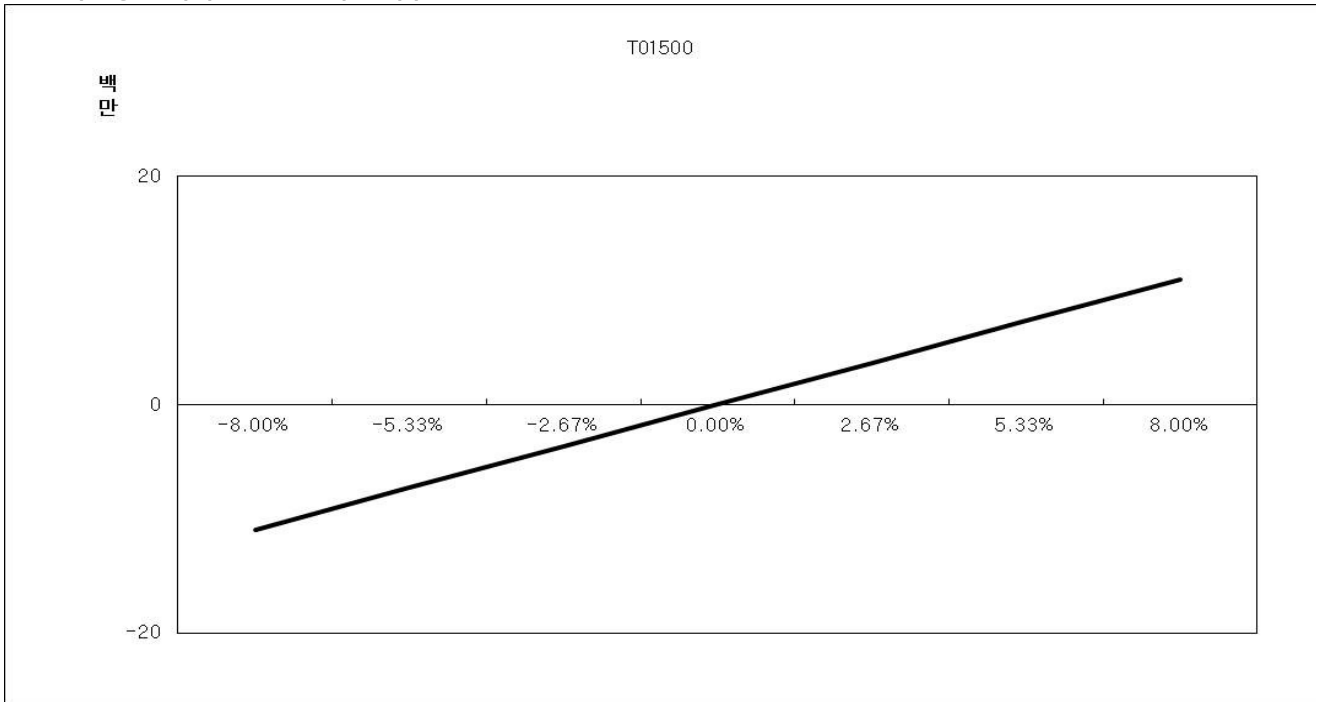
공시일: 2020-03-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	49	-49	장내
누계	주식	주식	679	0	679	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	47,342	3,641	43,700	장외
합계			48,021	3,641	44,379	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

13

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,799