

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-05-20

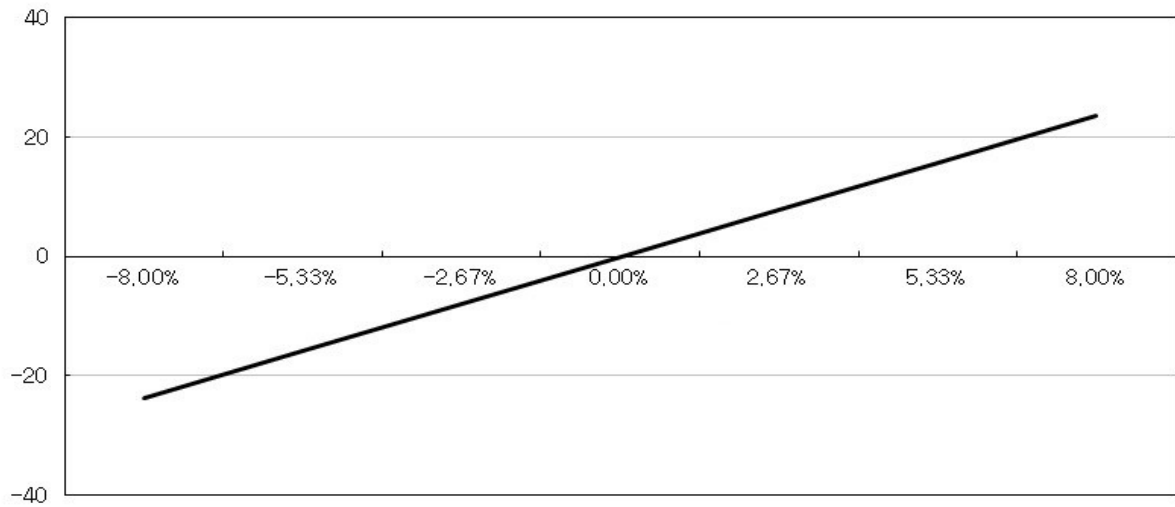
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	4,581	0	4,581	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	2,155	0	2,155	장내
합계			6,736	0	6,736	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

367

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

774

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

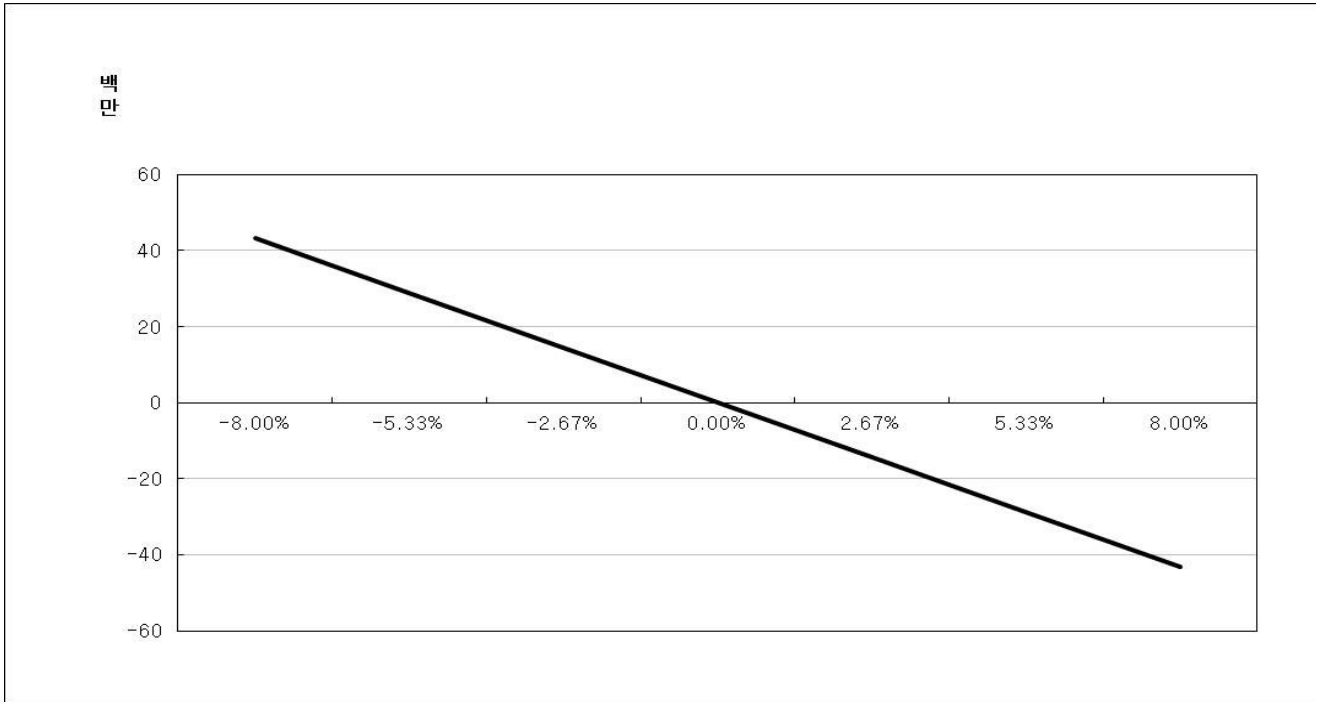
공시일: 2020-05-20

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	0	720	-720	장내
신규	주식	주식	397	284	114	장내
누계	주식	주식	5,518	879	4,639	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	950	-950	장내
합계			5,518	2,549	2,969	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

407

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

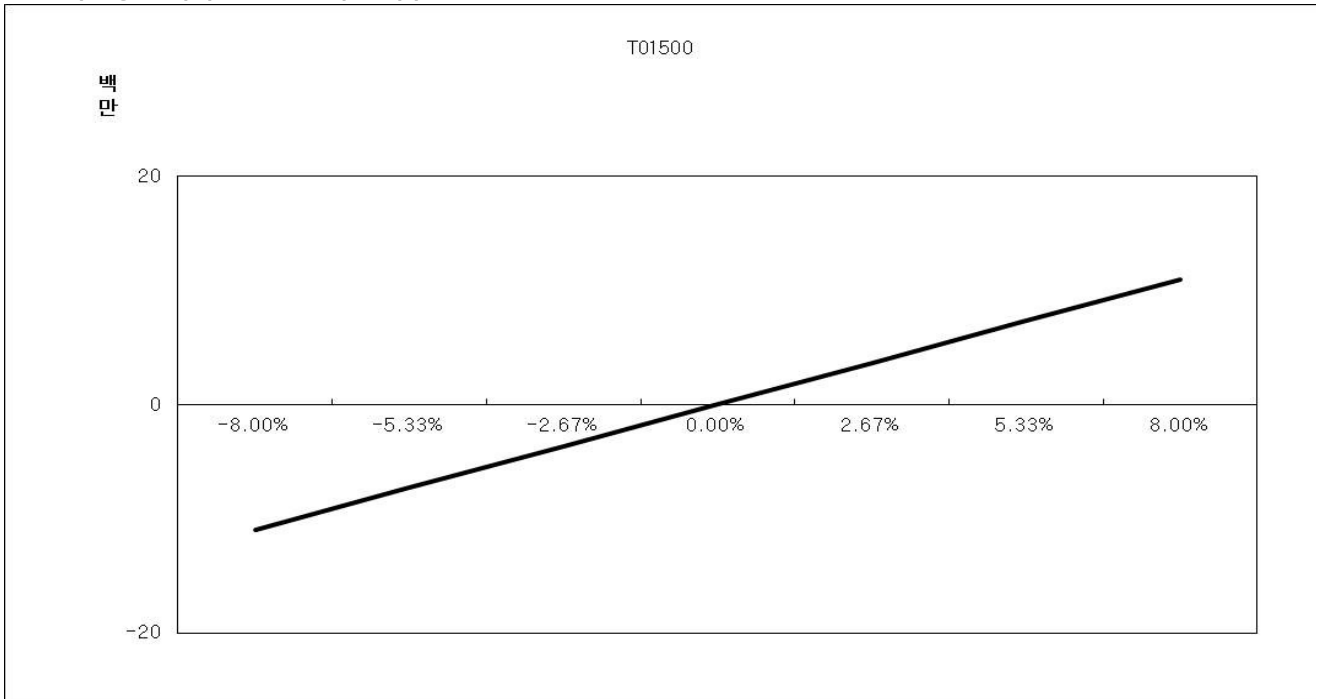
공시일: 2020-05-20

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	737	0	737	장내
신규	주가지수	스왑	149	24	125	장외
누계	주가지수	스왑	46,900	4,089	42,811	장외
합계			47,637	4,089	43,548	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,749