

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-01

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	140	0	140	장내
신규	주식	주식	2	2	0	장내
누계	주식	주식	6,925	0	6,925	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,072	0	7,072	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

940

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

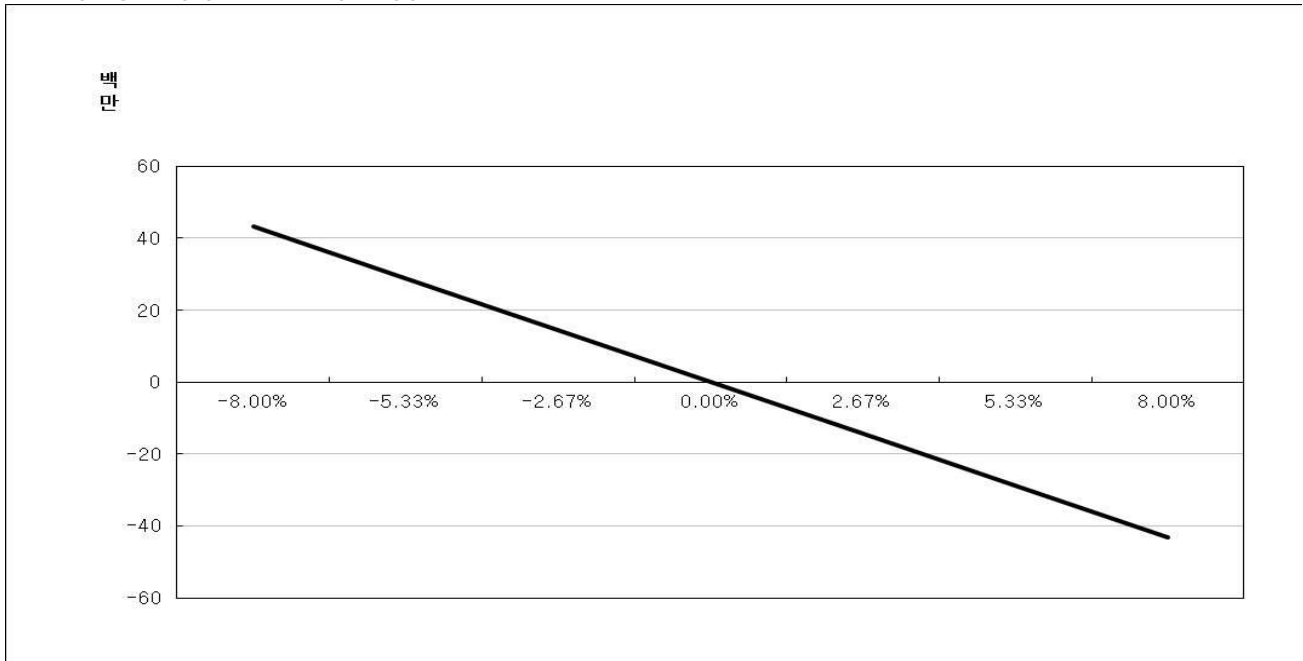
공시일: 2020-07-01

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	630	-630	장내
신규	주식	주식	6	1,107	-1,100	장내
누계	주식	주식	3,344	344	3,000	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,057	-1,057	장내
합계			3,344	2,032	1,312	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

51

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

256

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-07-01

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	529	0	529	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	44,187	4,629	39,557	장외
합계			44,716	4,629	40,086	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,725