

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-04-07

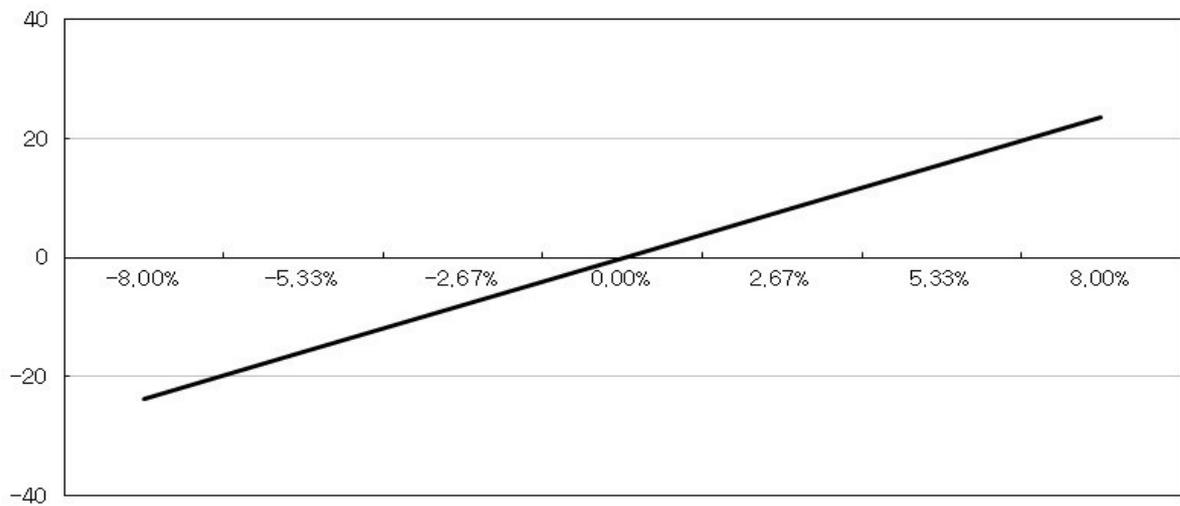
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	4,335	0	4,335	장내
신규	주식	주식	27	0	27	장내
누계	주식	주식	1,978	0	1,978	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	39	0	39	장내
합계			6,352	0	6,352	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

347

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

692

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

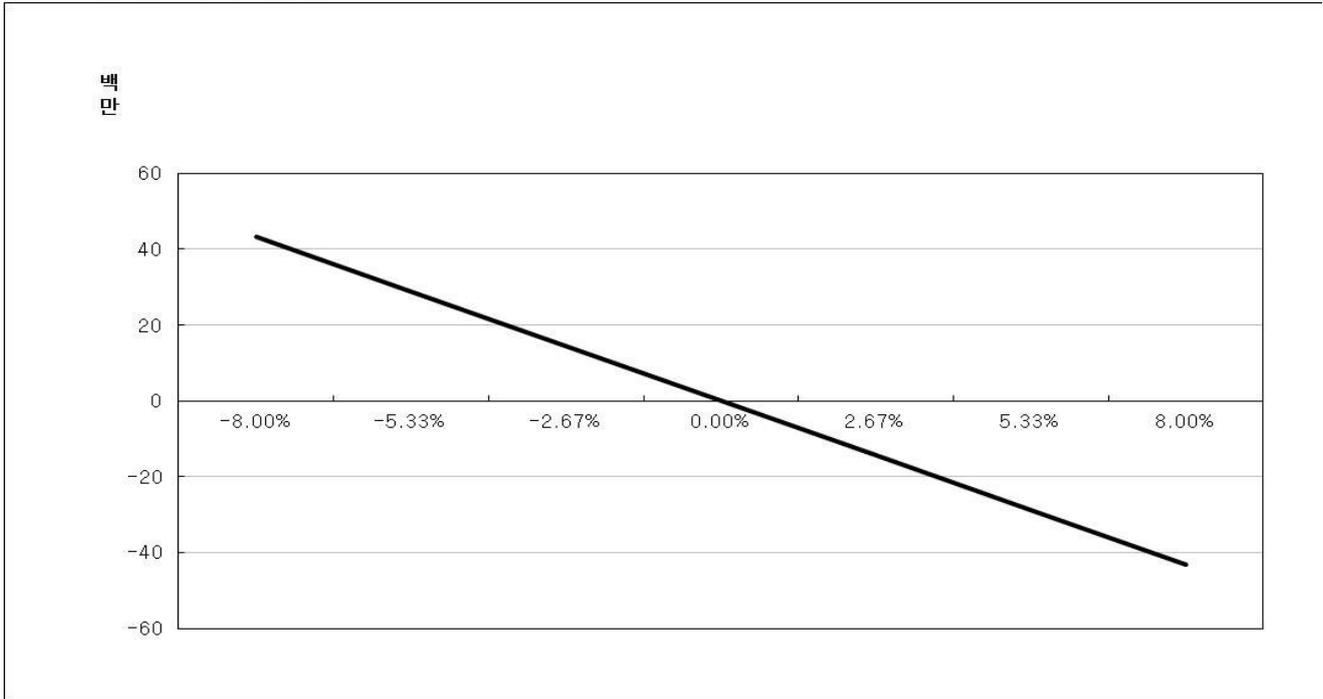
공시일: 2020-04-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	602	-602	장내
누계	주가지수	선물	0	1,204	-1,204	장내
신규	주식	주식	364	497	-132	장내
누계	주식	주식	6,390	795	5,596	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	95	-95	장내
합계			6,390	2,094	4,296	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

96

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

829

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

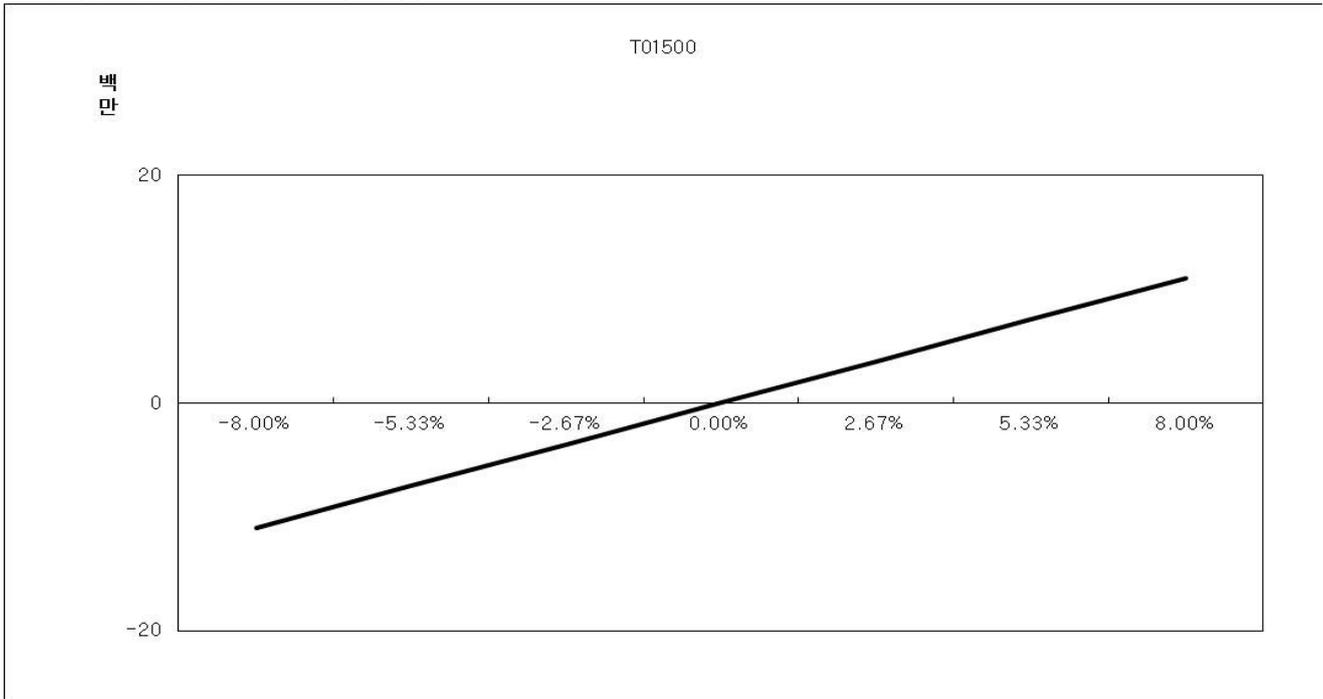
공시일: 2020-04-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	29	0	29	장내
누계	주식	주식	715	0	715	장내
신규	주가지수	스왑	0	1,916	-1,916	장외
누계	주가지수	스왑	38,405	3,550	34,855	장외
합계			39,119	3,550	35,569	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,422