

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-04-13

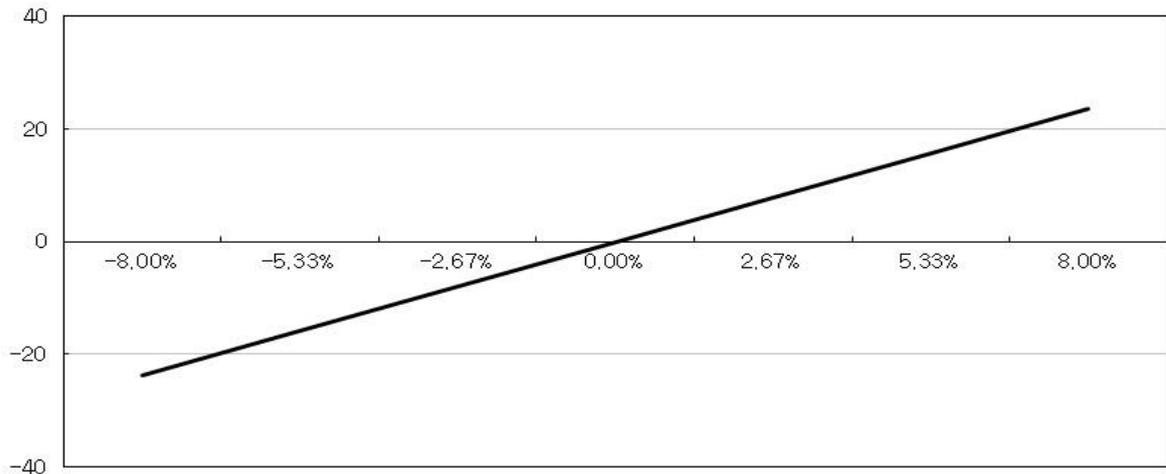
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	4,464	0	4,464	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	2,031	0	2,031	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	30	0	30	장내
합계			6,525	0	6,525	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

356

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

717

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

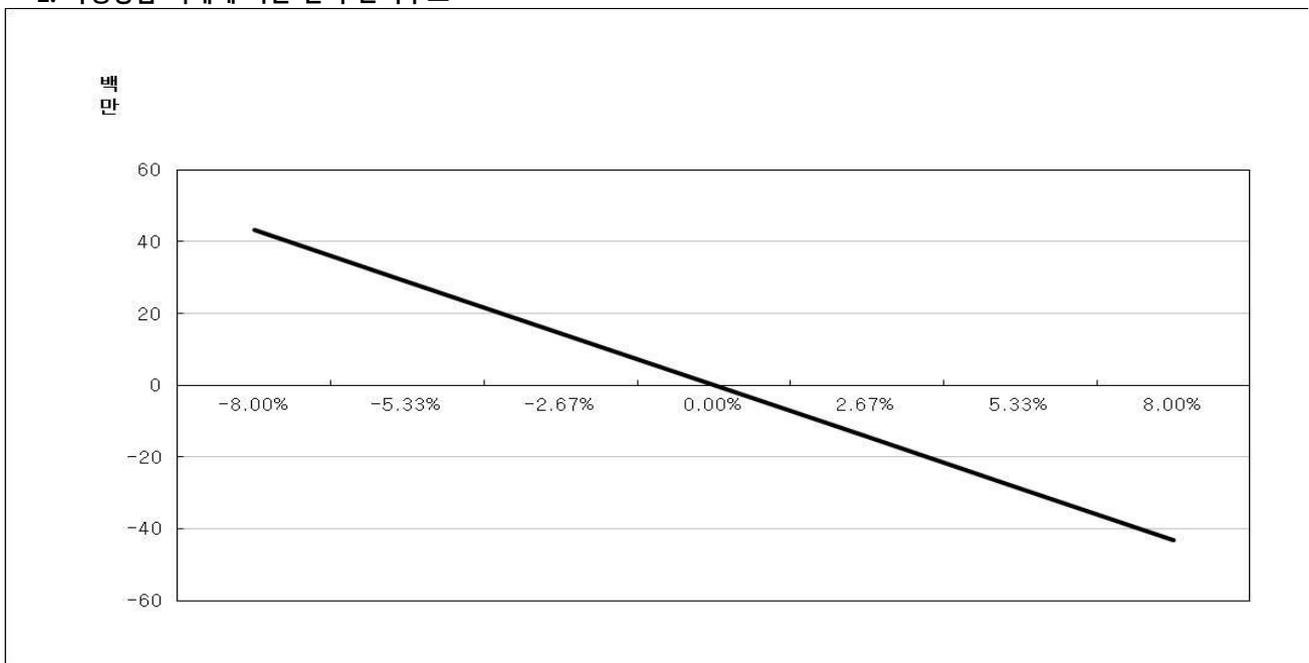
공시일: 2020-04-13

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	1,488	-1,488	장내
신규	주식	주식	0	116	-116	장내
누계	주식	주식	6,361	892	5,469	장내
합계			6,361	2,380	3,981	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

119

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

667

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-04-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	57	-57	장내
누계	주식	주식	718	0	718	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	40,175	3,648	36,527	장외
합계			40,893	3,648	37,245	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,505