

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-05-04

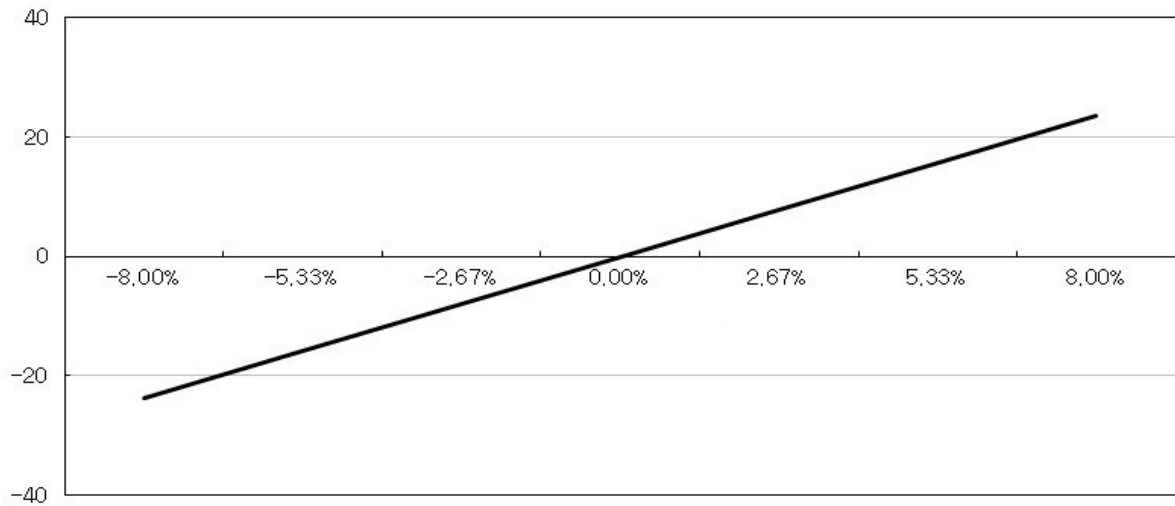
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	4,518	0	4,518	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	2,050	0	2,050	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	76	0	76	장내
합계			6,643	0	6,643	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

361

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

750

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

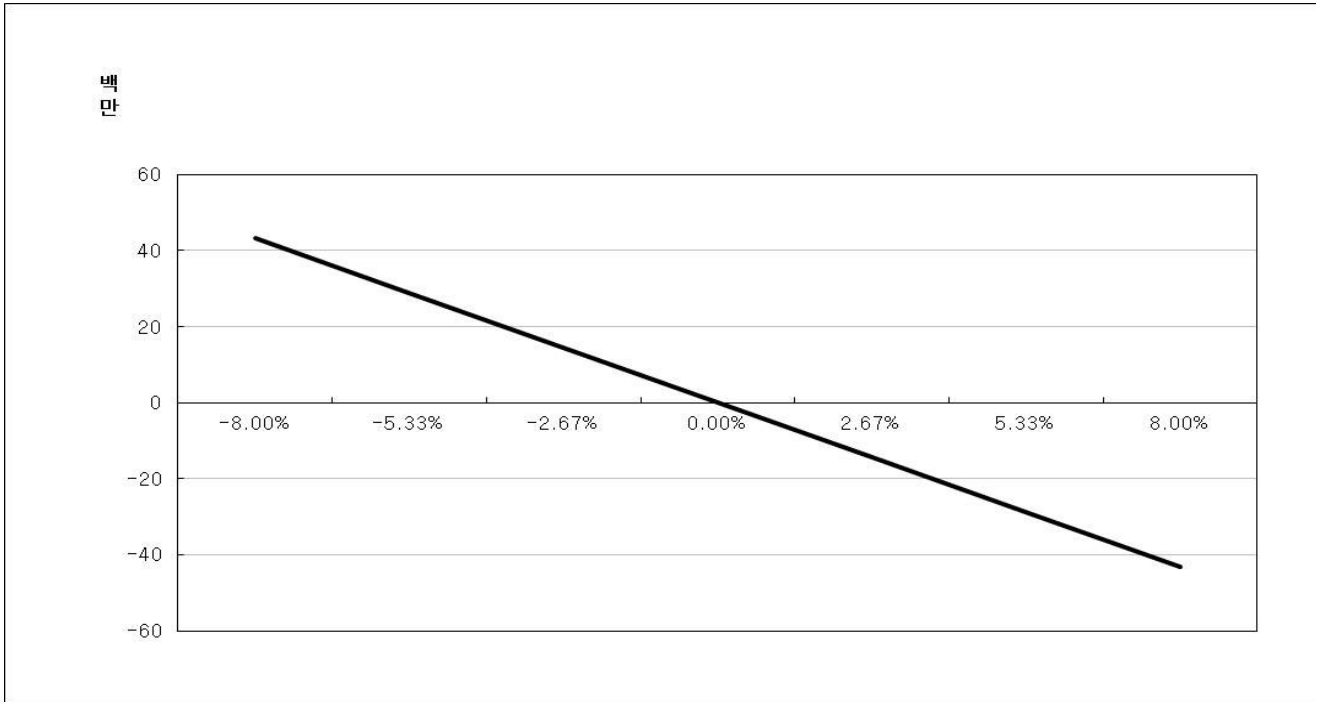
공시일: 2020-05-04

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	710	-710	장내
신규	주식	주식	0	789	-789	장내
누계	주식	주식	5,097	956	4,141	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	924	-924	장내
합계			5,097	2,590	2,507	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

57

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

331

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

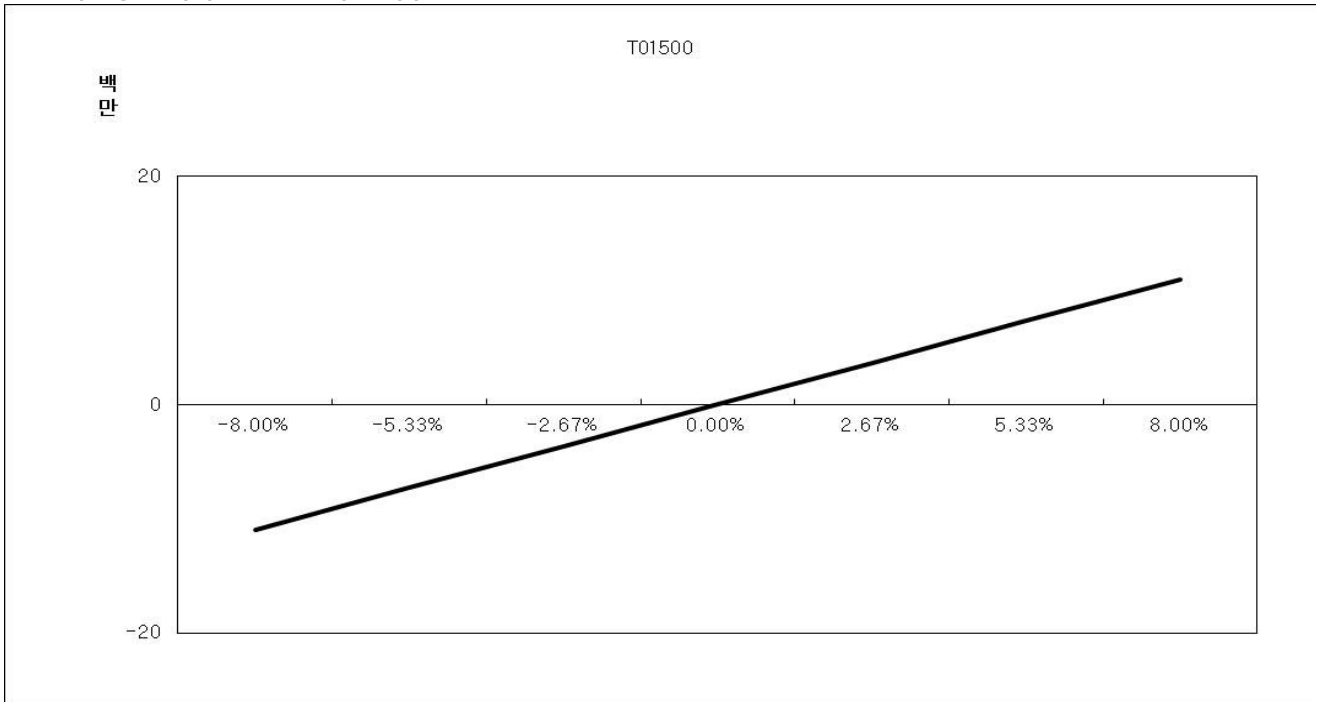
공시일: 2020-05-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	47	-47	장내
누계	주식	주식	712	0	712	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	40,508	3,905	36,602	장외
합계			41,219	3,905	37,314	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,534