

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-05-28

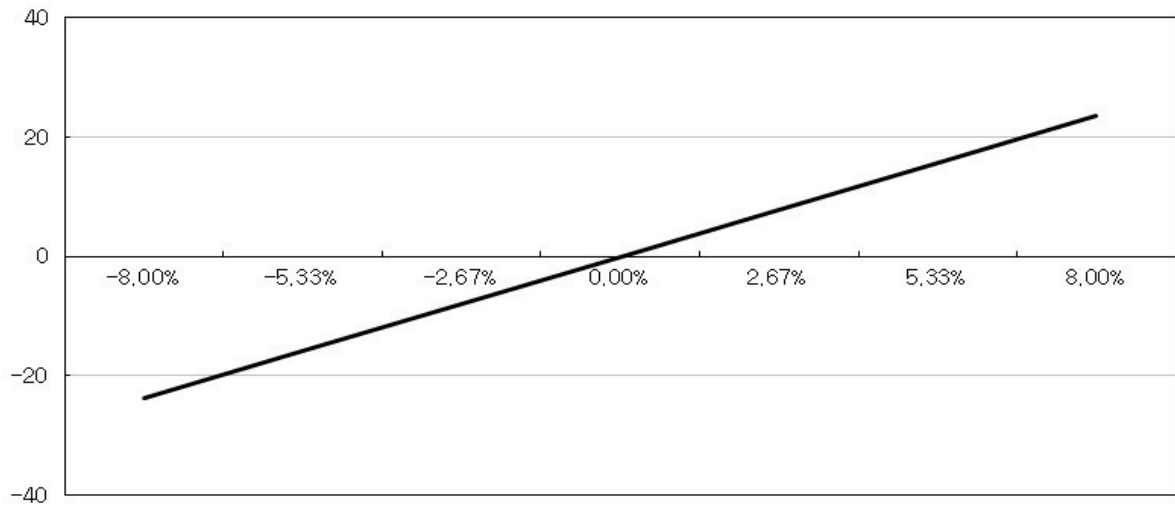
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	4,684	0	4,684	장내
신규	주식	주식	0	1	-1	장내
누계	주식	주식	2,203	0	2,203	장내
합계			6,886	0	6,886	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

374

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

793

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

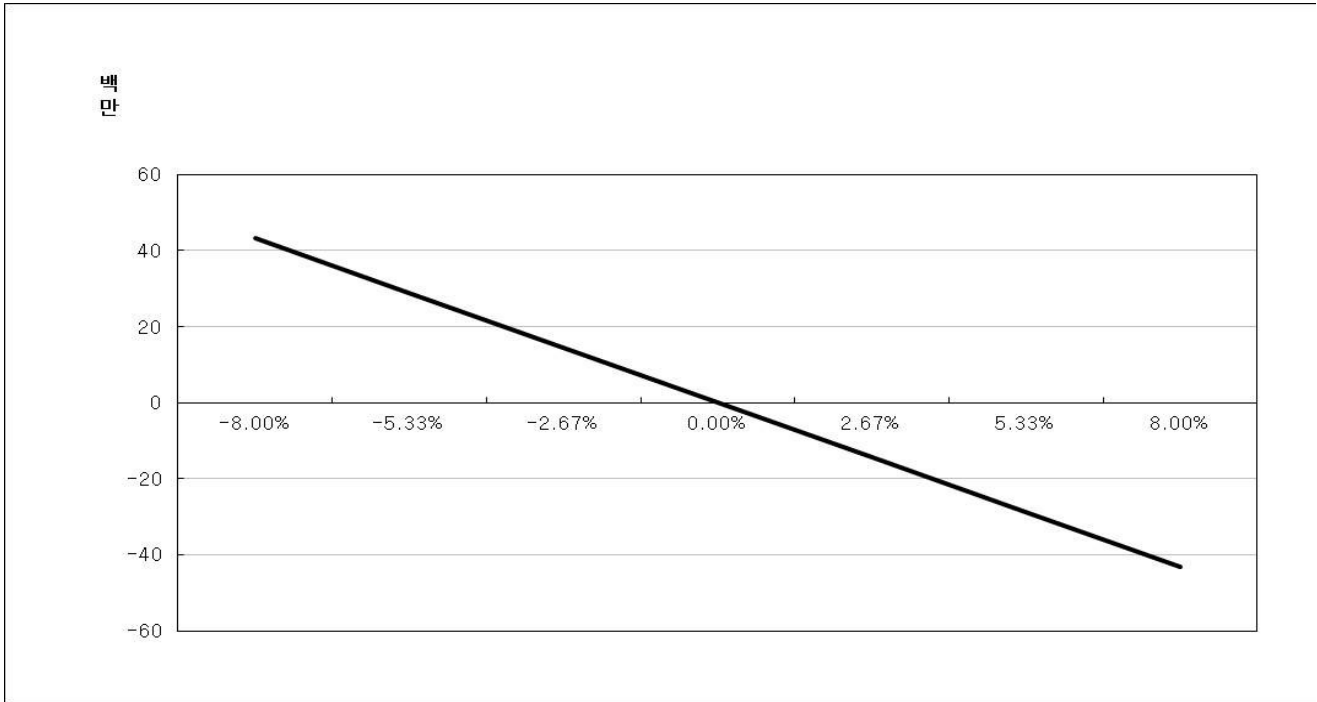
공시일: 2020-05-28

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	736	-736	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	5,967	925	5,042	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	969	-969	장내
합계			5,967	2,631	3,336	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

59

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

448

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

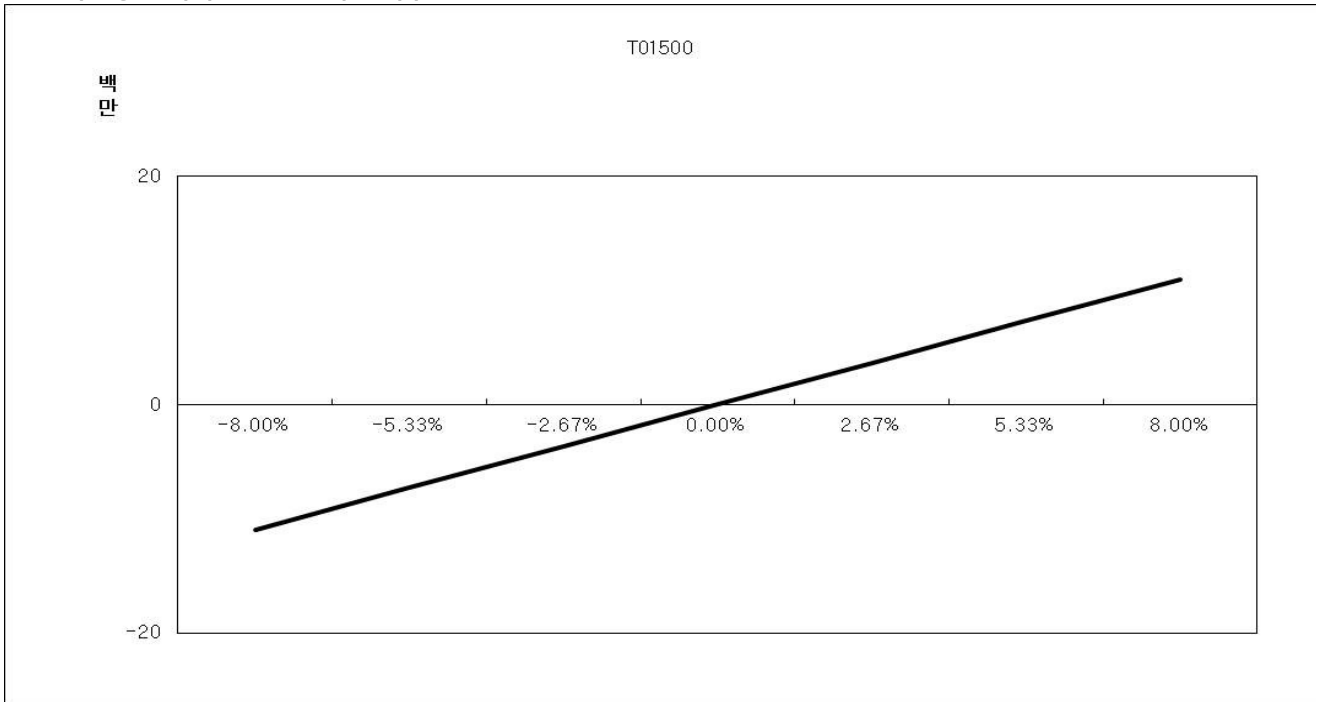
공시일: 2020-05-28

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	747	0	747	장내
신규	주가지수	스왑	27	21	6	장외
누계	주가지수	스왑	47,380	4,341	43,039	장외
합계			48,127	4,341	43,786	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,770