

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-06-03

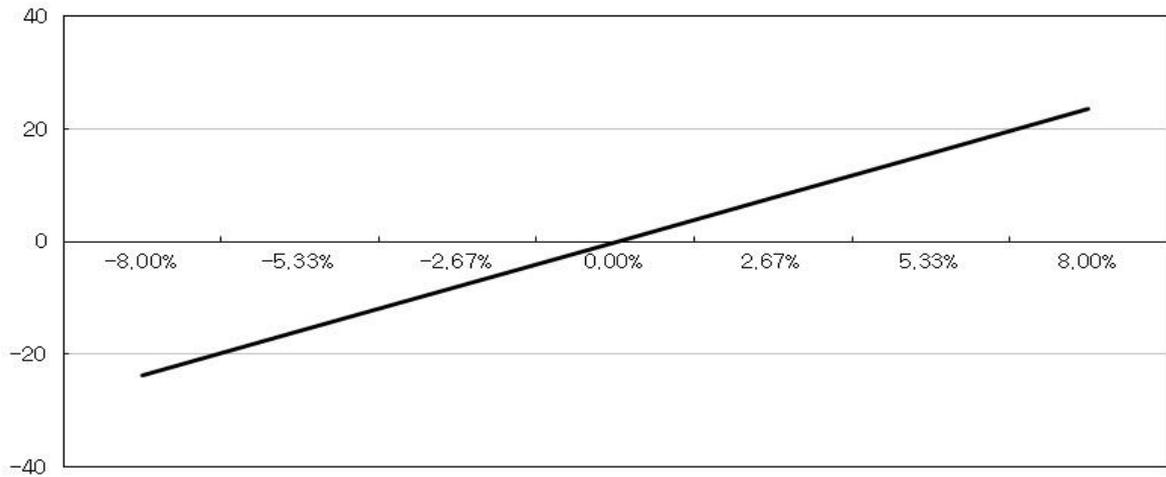
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	4,831	0	4,831	장내
신규	주식	주식	0	6	-6	장내
누계	주식	주식	2,262	0	2,262	장내
신규	유가증권	선물	6	0	6	장내
누계	유가증권	선물	6	0	6	장내
합계			7,100	0	7,100	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

386

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

827

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

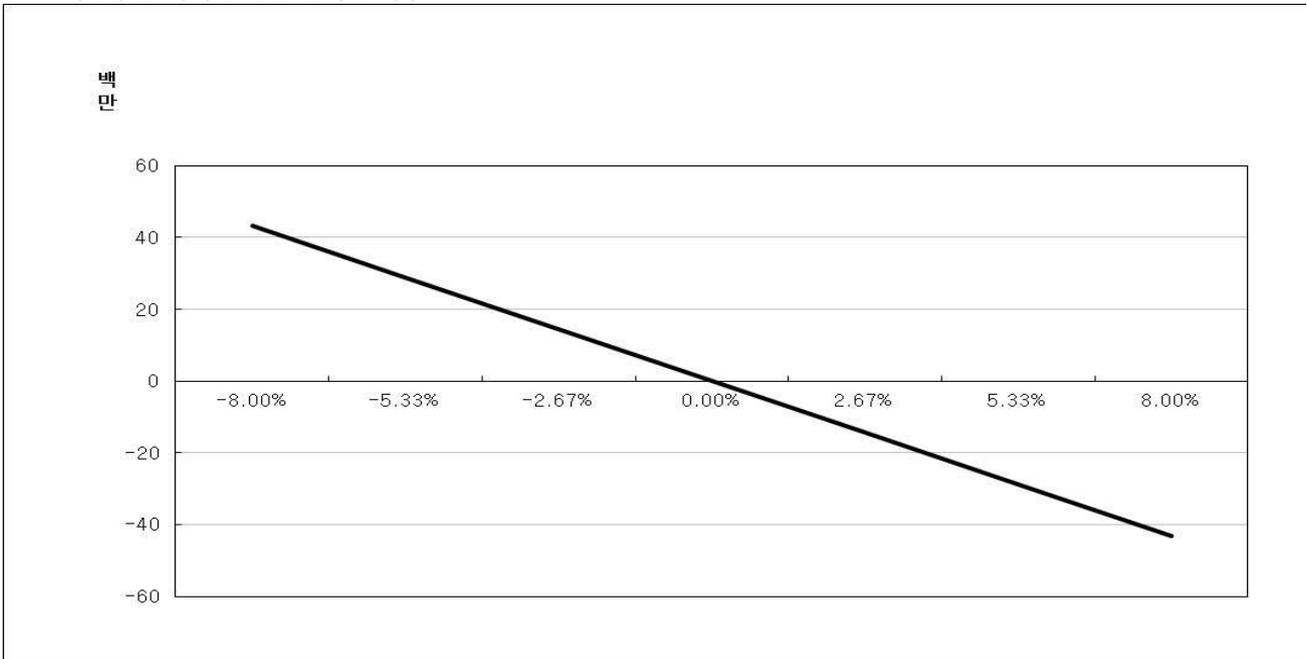
공시일: 2020-06-03

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	759	-759	장내
신규	주식	주식	39	161	-122	장내
누계	주식	주식	6,019	904	5,116	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,034	-1,034	장내
합계			6,019	2,697	3,322	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

455

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-06-03

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	753	0	753	장내
신규	주가지수	스왑	0	130	-130	장외
누계	주가지수	스왑	47,112	4,493	42,619	장외
합계			47,865	4,493	43,372	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,755