

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-06-11

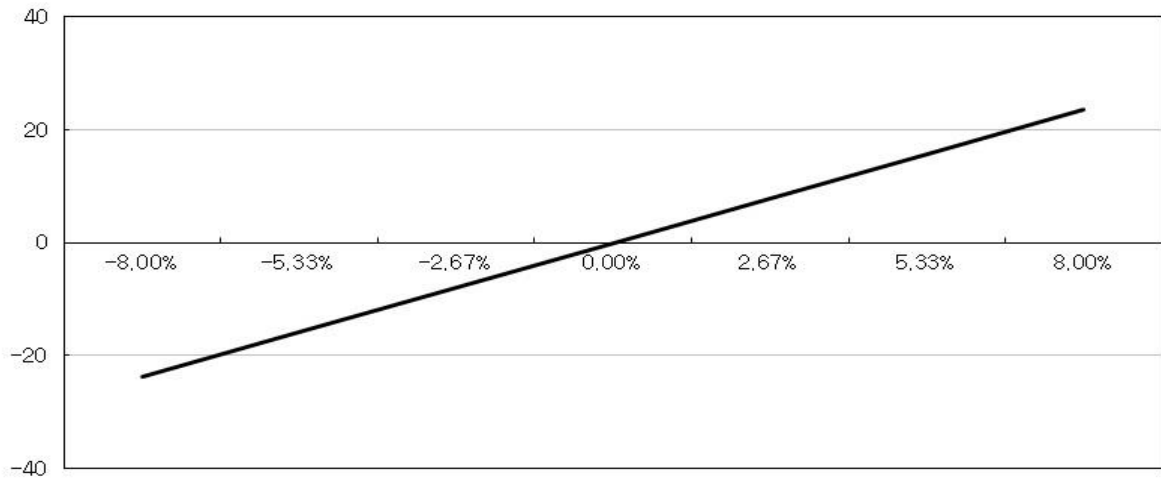
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	657	0	657	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	6,723	0	6,723	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,387	0	7,387	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

52

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

919

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

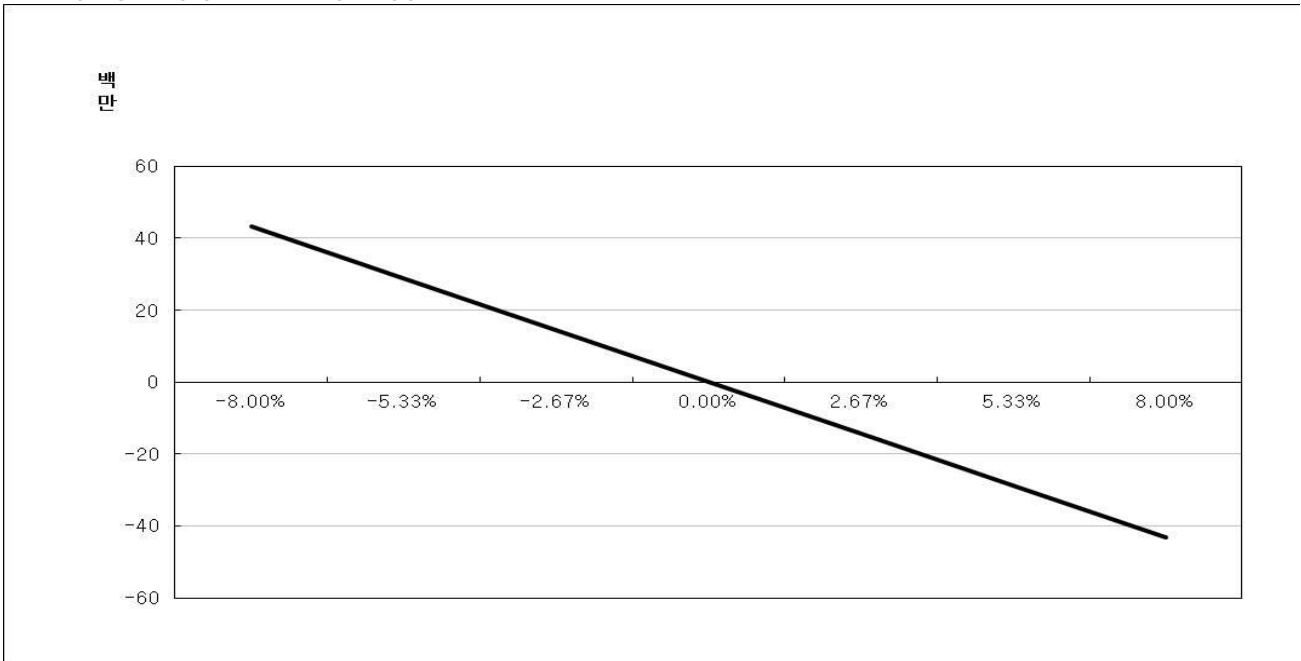
공시일: 2020-06-11

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	730	-730	장내
신규	주식	주식	71	109	-38	장내
누계	주식	주식	5,306	882	4,424	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,074	-1,074	장내
합계			5,306	2,686	2,621	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

377

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

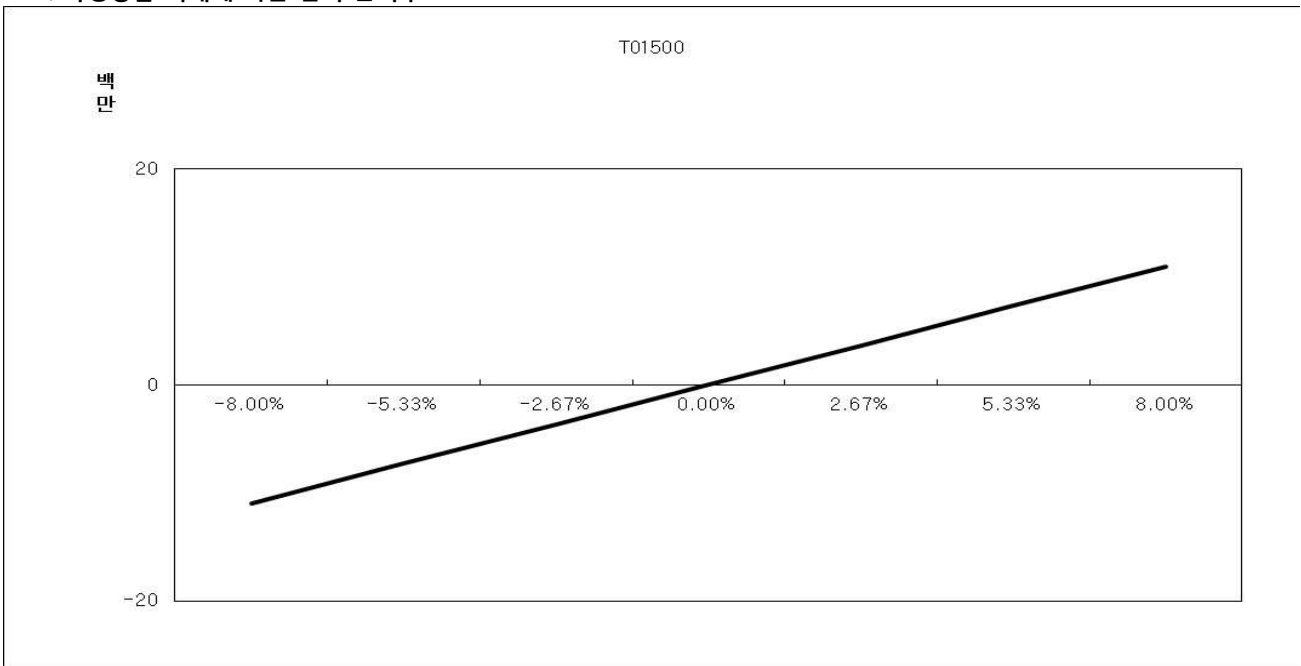
공시일: 2020-06-11

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	613	0	613	장내
신규	주가지수	스왑	0	21	-21	장외
누계	주가지수	스왑	44,083	4,564	39,519	장외
합계			44,695	4,564	40,132	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,701