

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-06-12

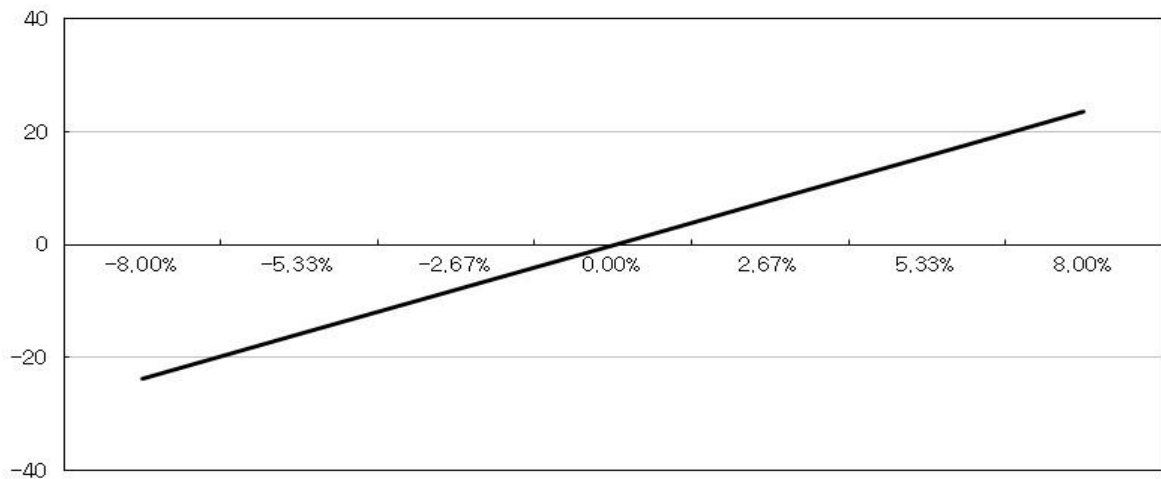
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	505	-505	장내
누계	주가지수	선물	144	0	144	장내
신규	주가지수	옵션	0	722	-722	장내
누계	주가지수	옵션	0	0	0	장내
신규	주식	주식	515	15	499	장내
누계	주식	주식	7,148	0	7,148	장내
신규	유가증권	선물	0	7	-7	장내
누계	유가증권	선물	0	0	0	장내
합계			7,292	0	7,292	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

929

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

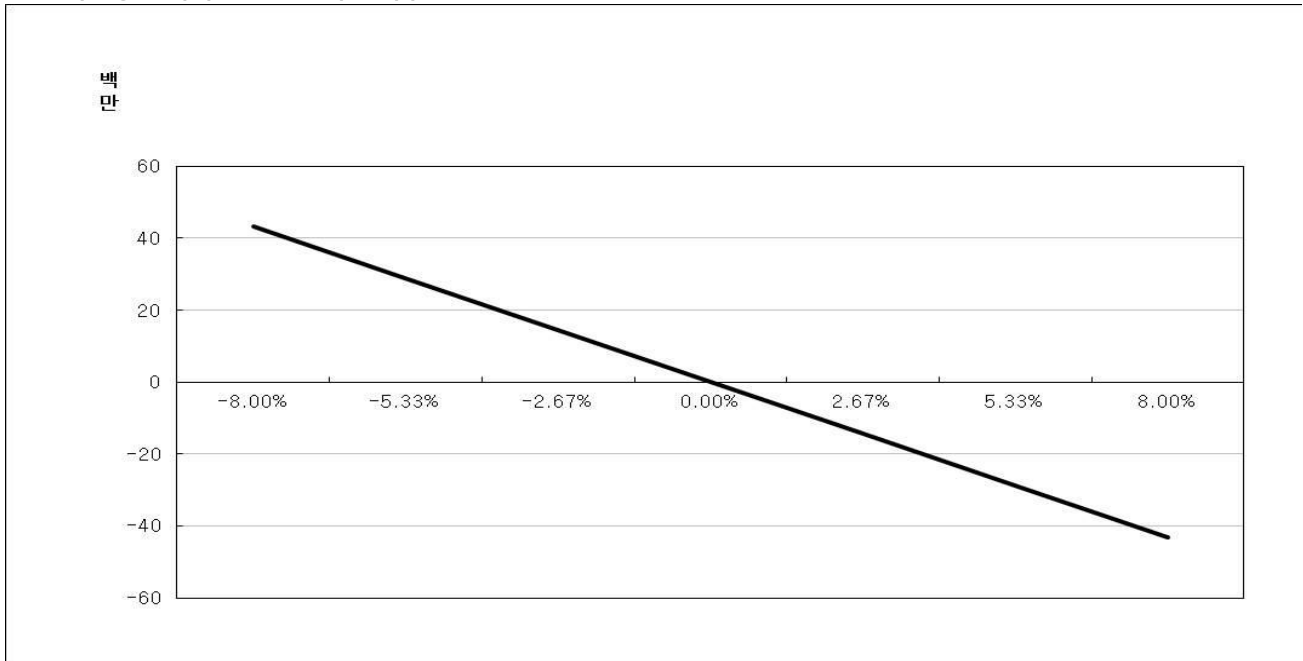
공시일: 2020-06-12

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	72	0	72	장내
누계	주가지수	선물	0	649	-649	장내
신규	주식	주식	86	182	-96	장내
누계	주식	주식	5,152	908	4,244	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,069	-1,069	장내
합계			5,152	2,625	2,526	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

52

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

358

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

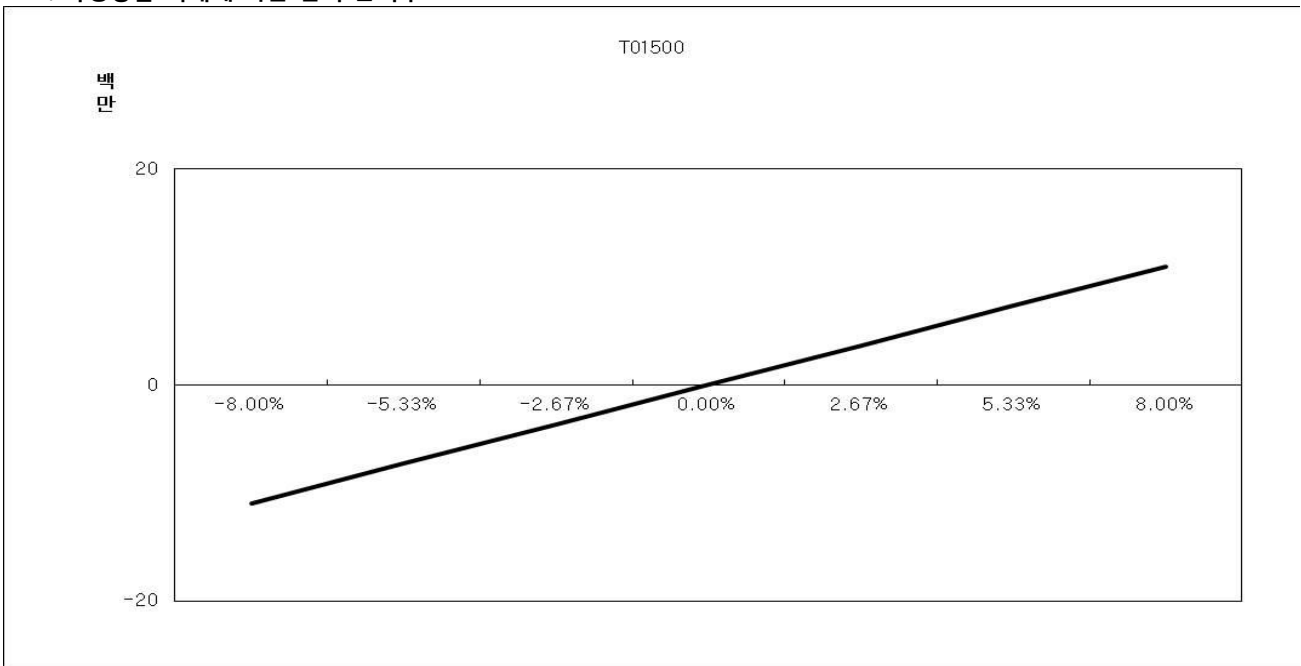
공시일: 2020-06-12

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	608	0	608	장내
신규	주가지수	스왑	15,357	0	15,357	장외
누계	주가지수	스왑	59,556	4,505	55,051	장외
합계			60,164	4,505	55,659	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,392