

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-06-24

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	141	0	141	장내
신규	주식	주식	6	0	6	장내
누계	주식	주식	6,970	0	6,970	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,118	0	7,118	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

940

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

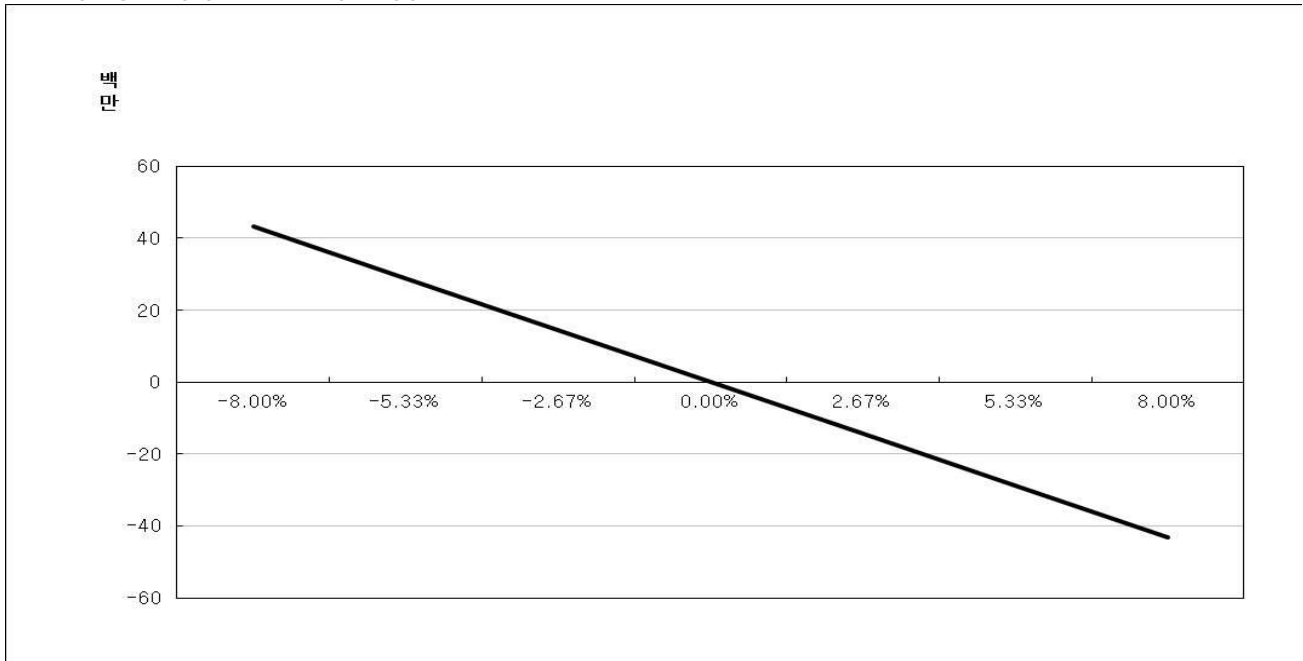
공시일: 2020-06-24

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	634	-634	장내
신규	주식	주식	563	436	127	장내
누계	주식	주식	4,679	359	4,320	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,052	-1,052	장내
합계			4,679	2,045	2,633	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

51

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

381

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-06-24

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	585	0	585	장내
신규	주가지수	스왑	0	15,965	-15,965	장외
누계	주가지수	스왑	44,459	4,695	39,764	장외
합계			45,044	4,695	40,349	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,719