

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-06-25

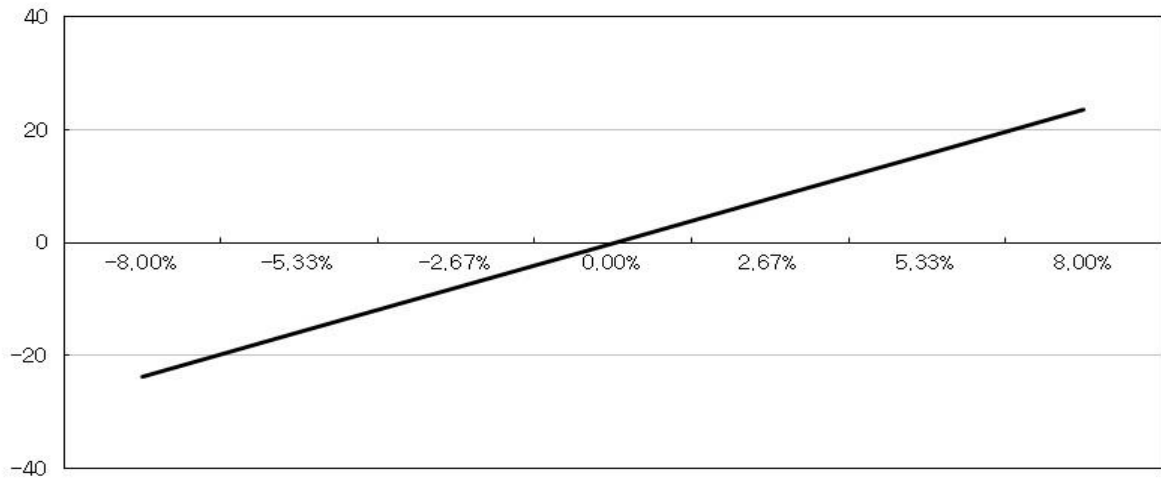
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	143	0	143	장내
신규	주식	주식	2	0	2	장내
누계	주식	주식	7,092	0	7,092	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,242	0	7,242	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

958

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

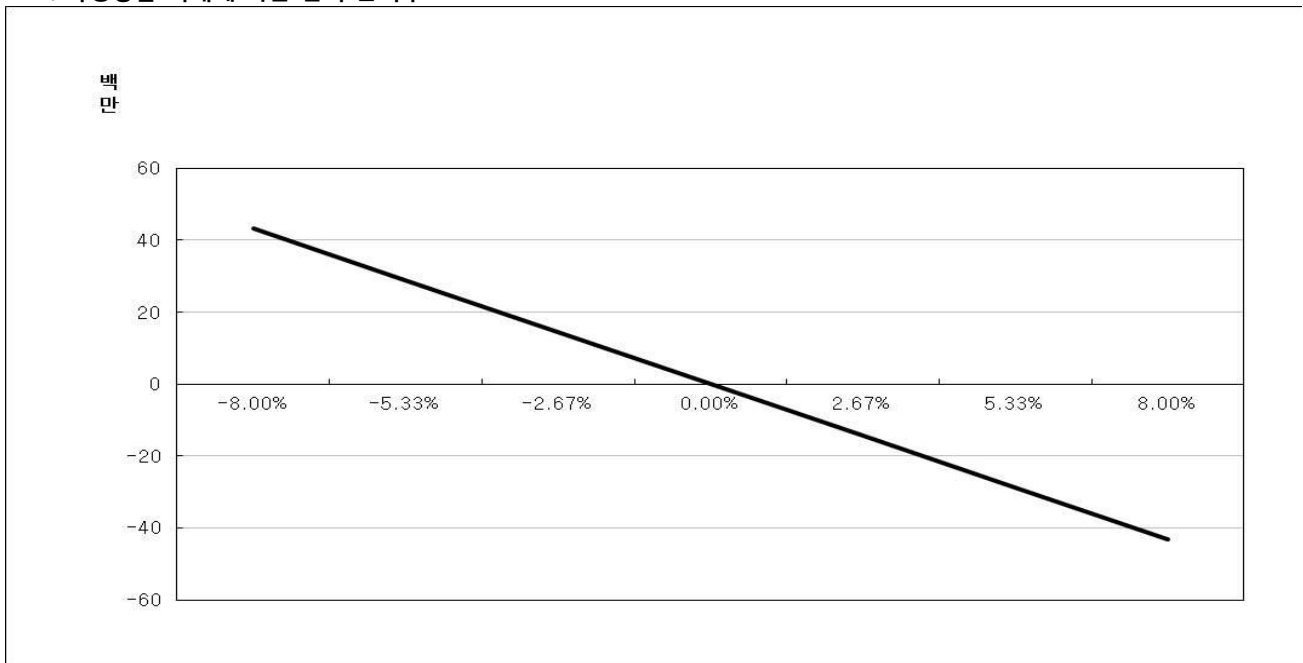
공시일: 2020-06-25

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	645	-645	장내
신규	주식	주식	210	469	-260	장내
누계	주식	주식	4,392	325	4,066	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,069	-1,069	장내
합계			4,392	2,040	2,352	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

51

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

350

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

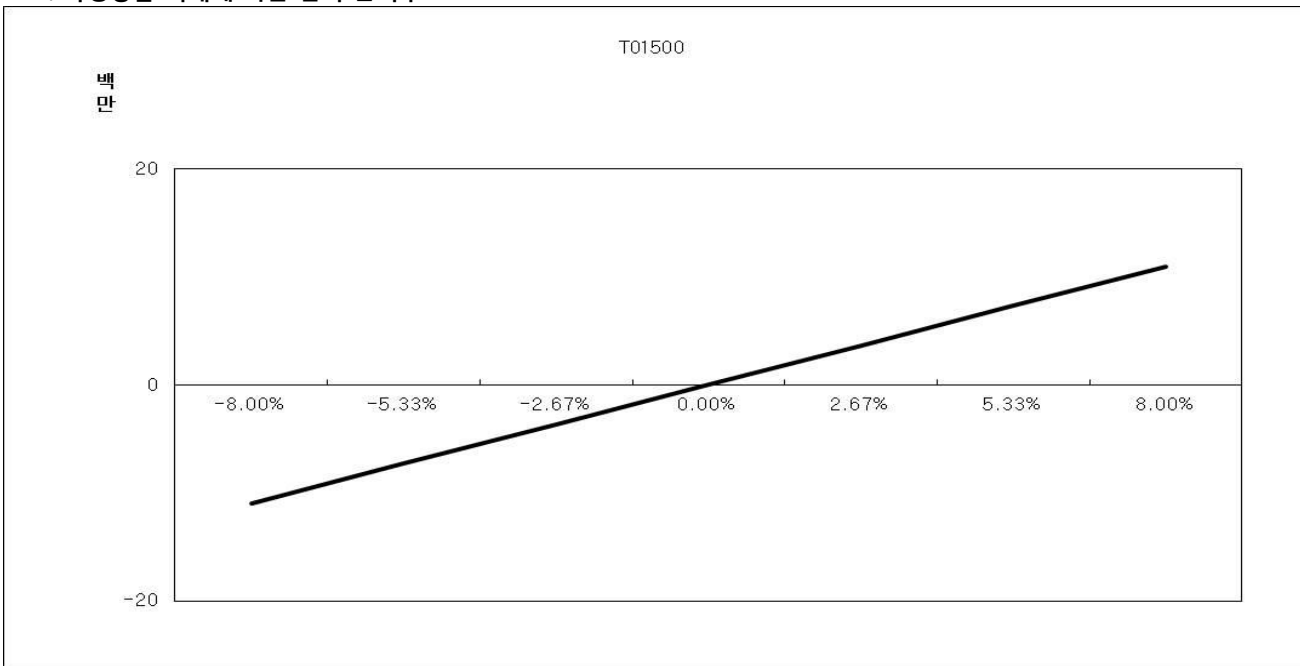
공시일: 2020-06-25

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	589	0	589	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	44,099	4,656	39,443	장외
합계			44,687	4,656	40,032	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,712