

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-02

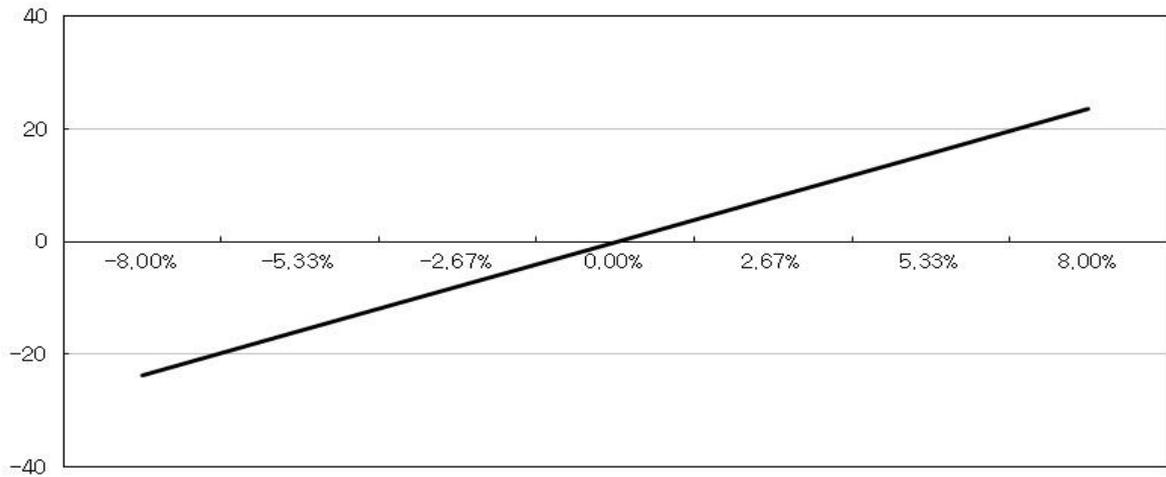
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	140	0	140	장내
신규	주식	주식	1	0	1	장내
누계	주식	주식	6,932	0	6,932	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,078	0	7,078	

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)

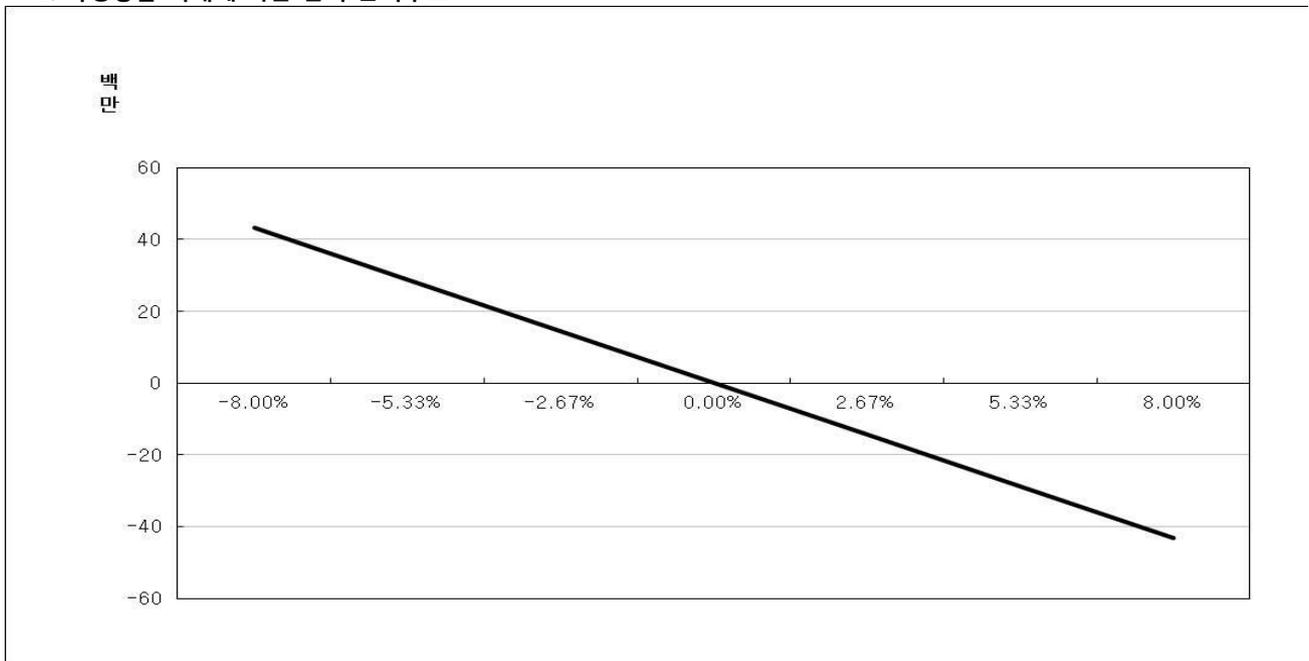
공시일: 2020-07-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	631	0	631	장내
누계	주가지수	선물	0	0	0	장내
신규	주식	주식	462	616	-154	장내
누계	주식	주식	2,859	0	2,859	장내
신규	유가증권	선물	263	260	3	장내
누계	유가증권	선물	0	1,054	-1,054	장내
합계			2,859	1,054	1,805	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

292

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-07-02

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	528	0	528	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	44,218	4,626	39,592	장외
합계			44,746	4,626	40,120	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,723