

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-06-04

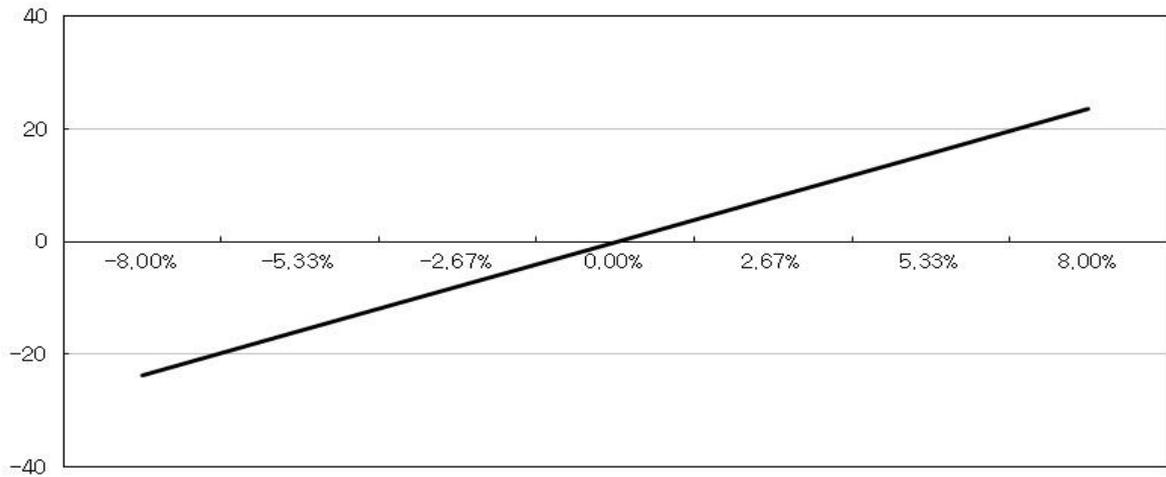
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	643	4,932	-4,289	장내
누계	주가지수	선물	715	0	715	장내
신규	주식	주식	4,185	0	4,185	장내
누계	주식	주식	6,526	0	6,526	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,248	0	7,248	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

57

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

905

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

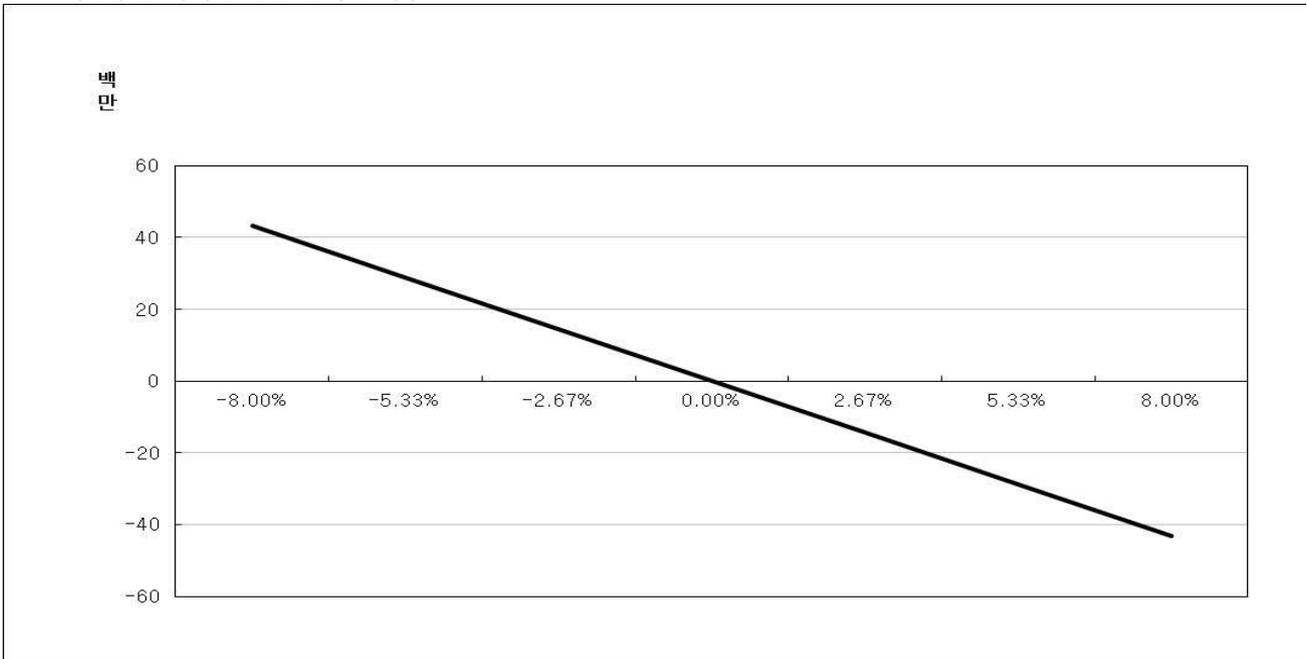
공시일: 2020-06-04

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	786	-786	장내
신규	주식	주식	408	1,083	-675	장내
누계	주식	주식	5,453	916	4,537	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,047	-1,047	장내
합계			5,453	2,750	2,704	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

63

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

384

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	149	-149	장내
누계	주식	주식	615	0	615	장내
신규	주가지수	스왑	0	27	-27	장외
누계	주가지수	스왑	46,736	4,499	42,237	장외
합계			47,351	4,499	42,852	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,757