

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-06

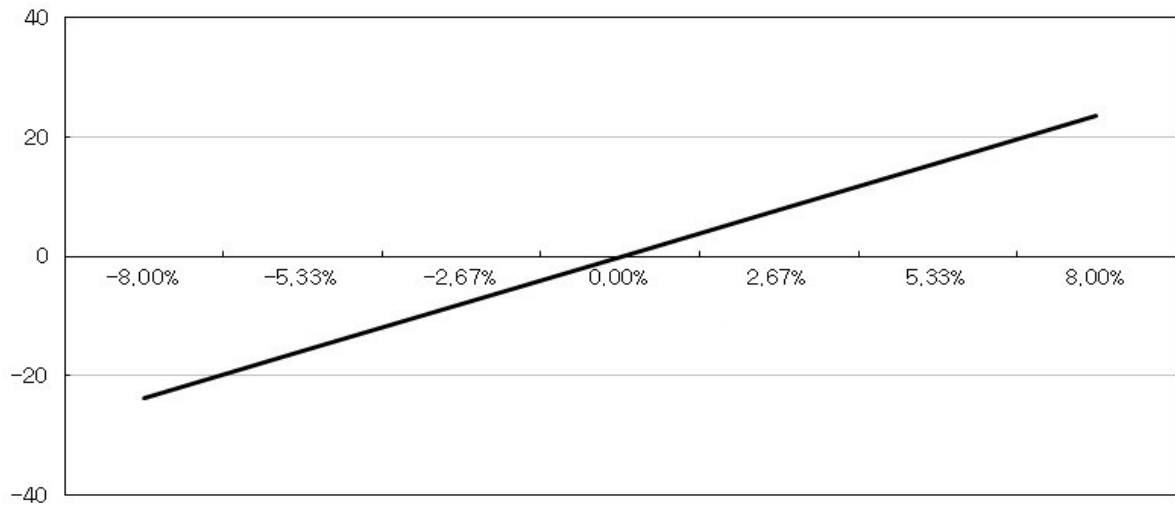
1. 계약금액

(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	0	0	0	장내
누계	주식	주식	7,063	0	7,063	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,213	0	7,213	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

961

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

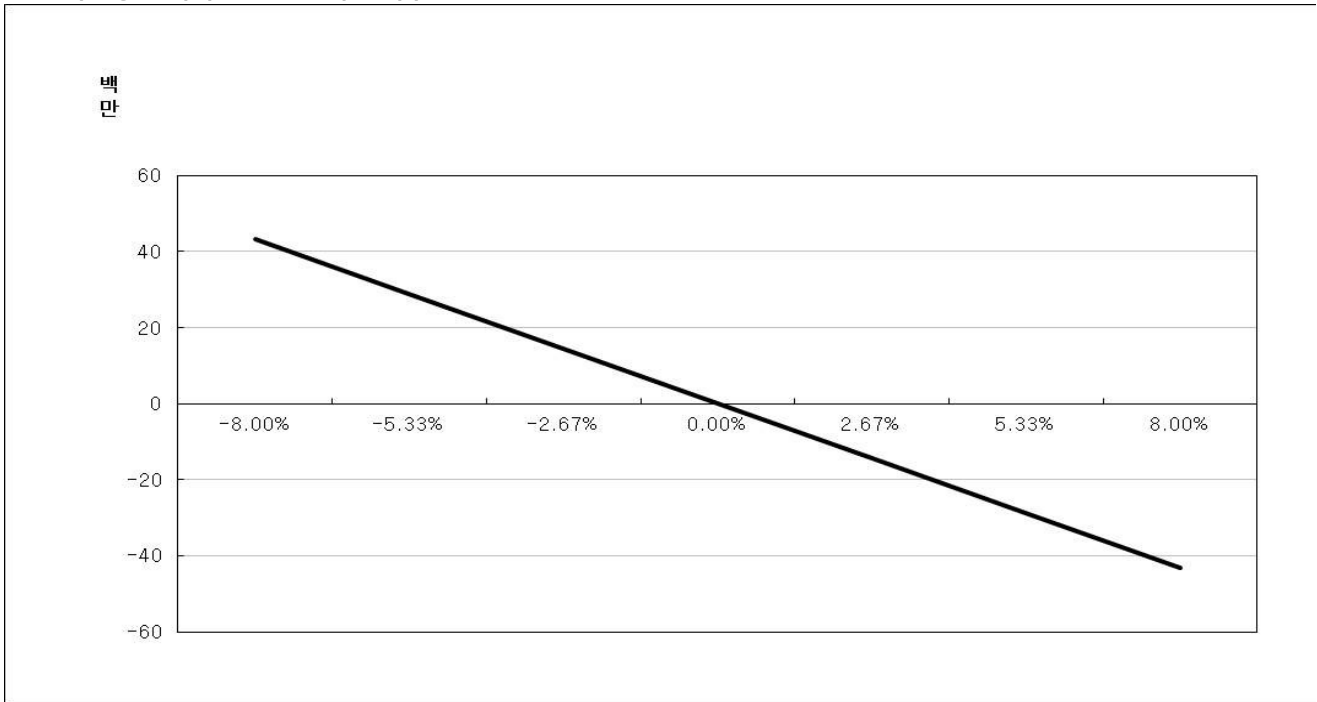
공시일: 2020-07-06

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	3,239	0	3,239	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,069	-1,069	장내
합계			3,239	1,069	2,171	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

334

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

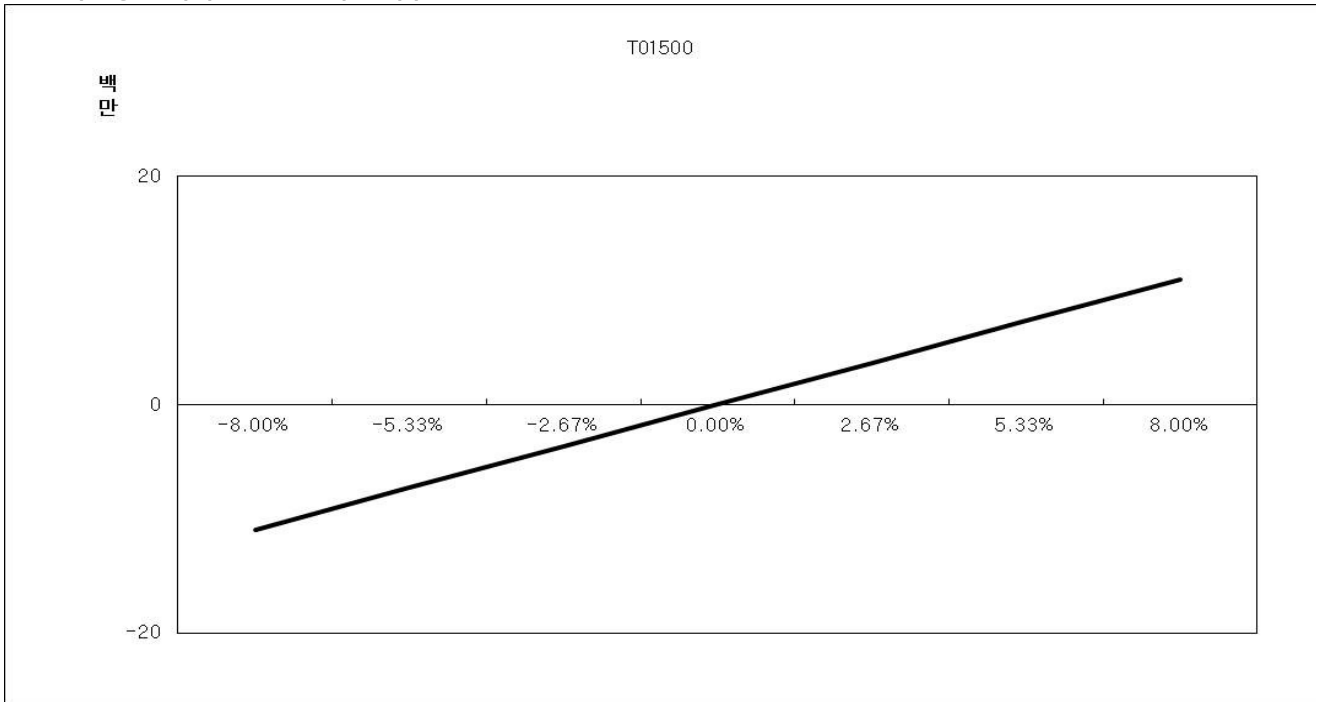
공시일: 2020-07-06

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	538	0	538	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	44,130	4,791	39,339	장외
합계			44,668	4,791	39,877	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,713