

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-08

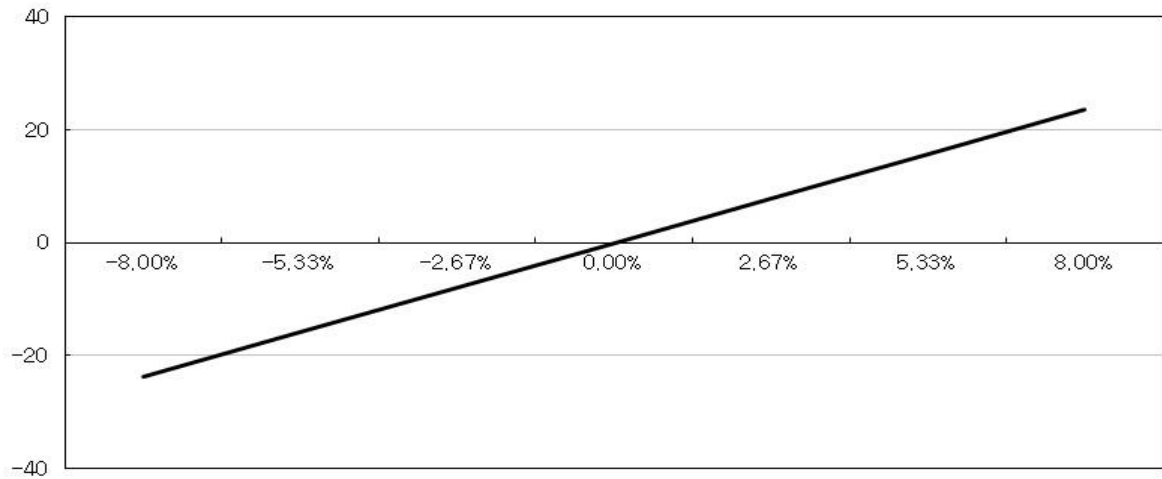
1. 계약금액

(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	3	-1	장내
누계	주식	주식	7,075	0	7,075	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,225	0	7,225	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

963

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

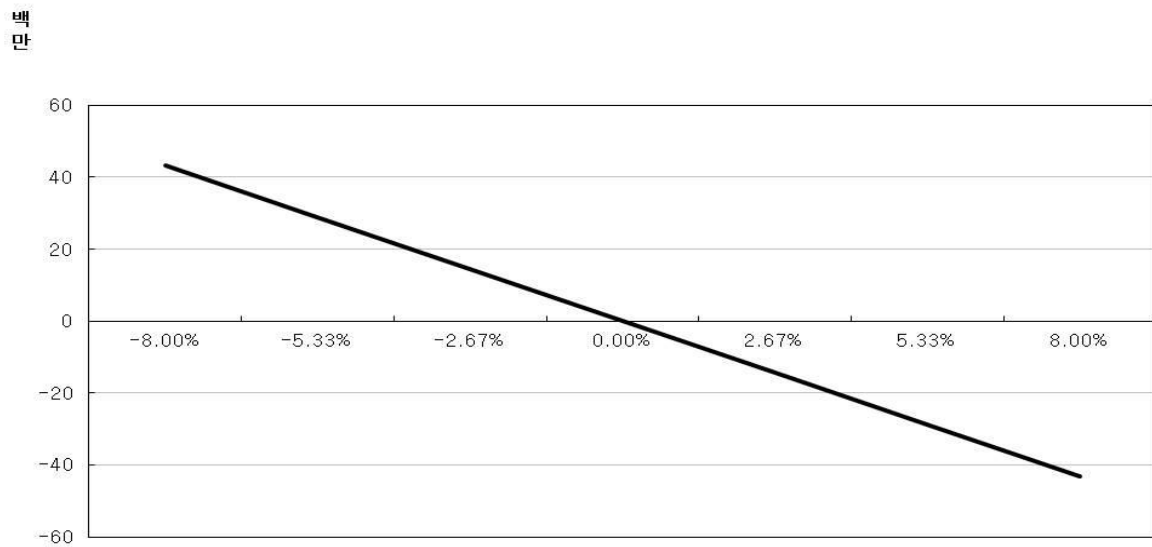
공시일: 2020-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	451	-451	장내
누계	주식	주식	2,830	0	2,830	장내
신규	유가증권	선물	399	453	-54	장내
누계	유가증권	선물	0	1,111	-1,111	장내
합계			2,830	1,111	1,719	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

300

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

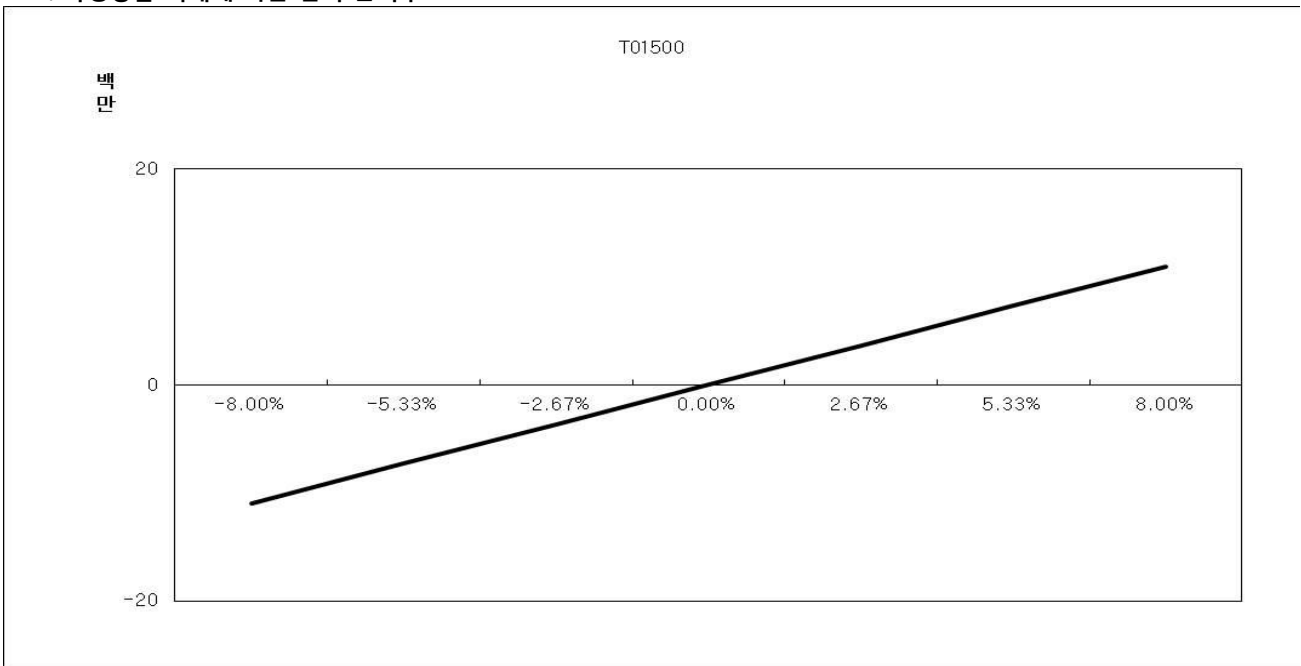
공시일: 2020-07-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	50	49	1	장내
누계	주식	주식	537	0	537	장내
신규	주가지수	스왑	1,188	654	535	장외
누계	주가지수	스왑	43,618	3,816	39,802	장외
합계			44,155	3,816	40,339	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,683