

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-09

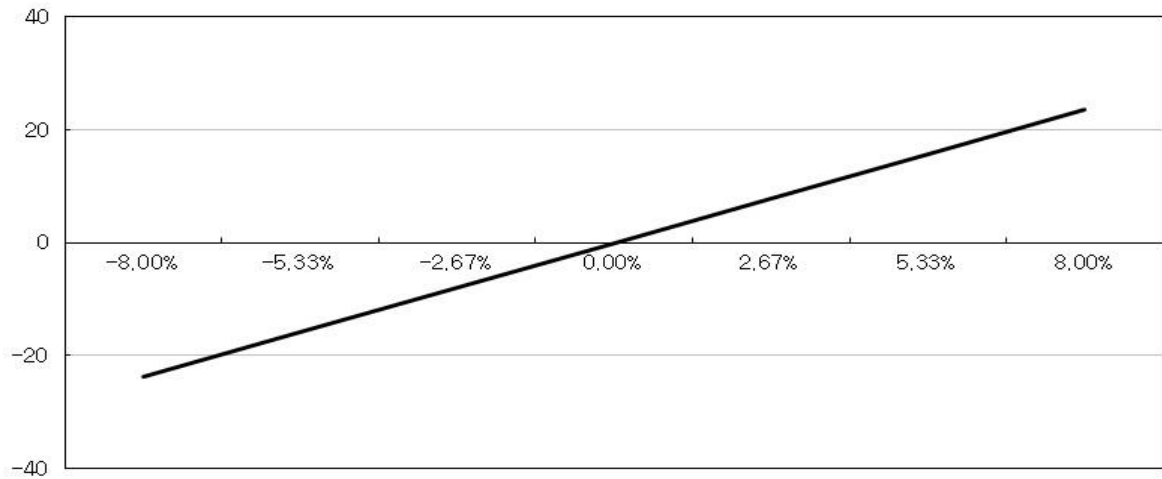
1. 계약금액

(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	5	2	3	장내
누계	주식	주식	7,057	0	7,057	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	7	0	7	장내
합계			7,207	0	7,207	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

960

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-09

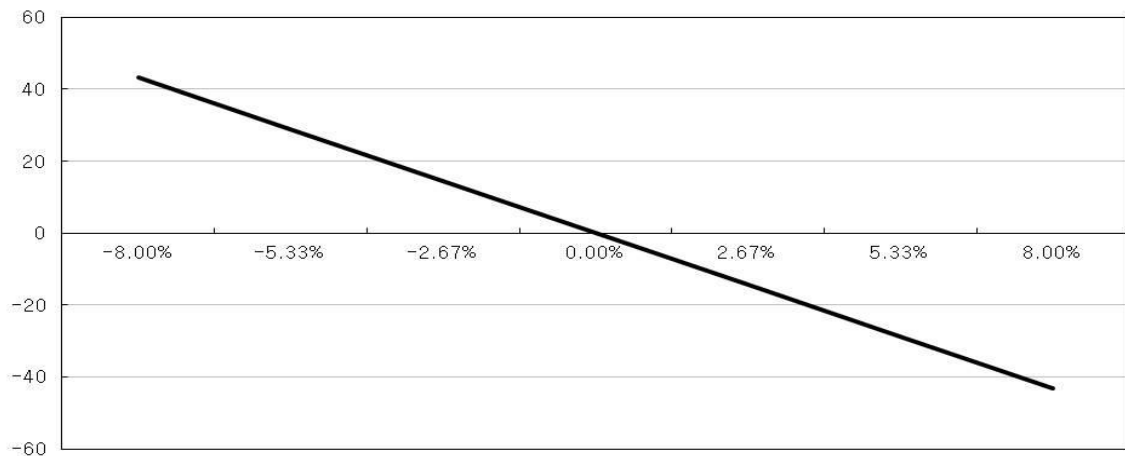
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	128	96	32	장내
누계	주식	주식	2,901	0	2,901	장내
신규	유가증권	선물	1,105	1,105	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,105	-1,105	장내
합계			2,901	1,105	1,795	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

321

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

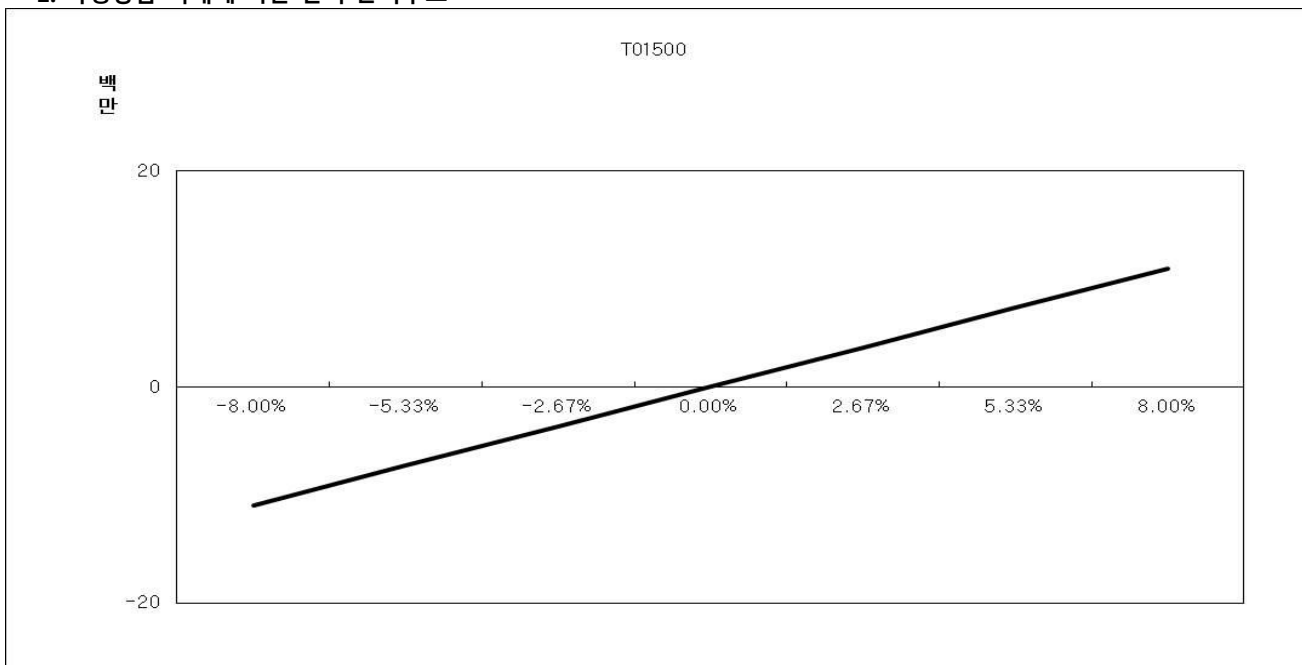
공시일: 2020-07-09

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	539	0	539	장내
신규	주가지수	스왑	90	43	47	장외
누계	주가지수	스왑	43,694	3,859	39,835	장외
합계			44,233	3,859	40,374	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,680