

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-10

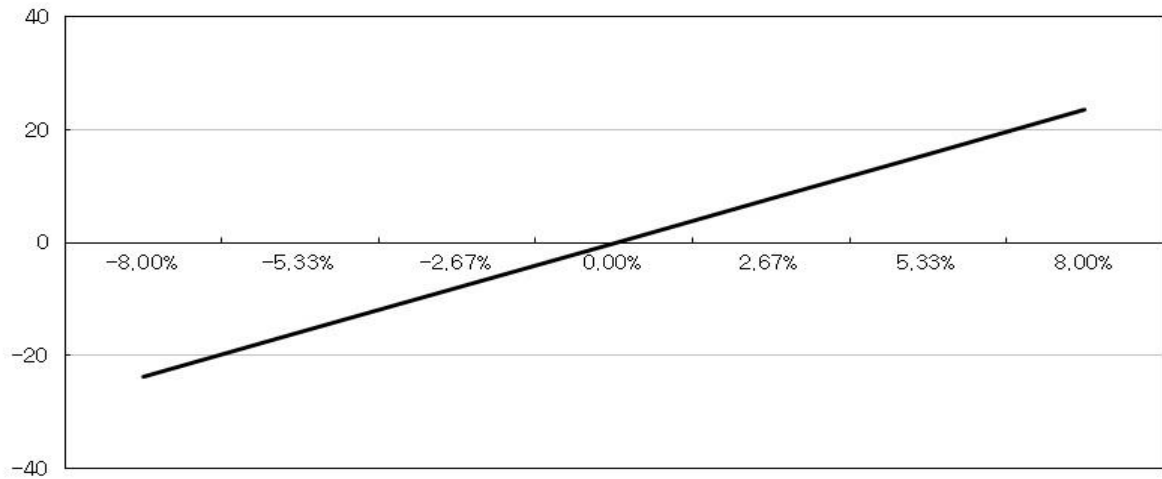
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	144	0	144	장내
신규	주식	주식	9	3	5	장내
누계	주식	주식	7,095	0	7,095	장내
신규	유가증권	선물	0	7	-7	장내
누계	유가증권	선물	0	0	0	장내
합계			7,239	0	7,239	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

965

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-10

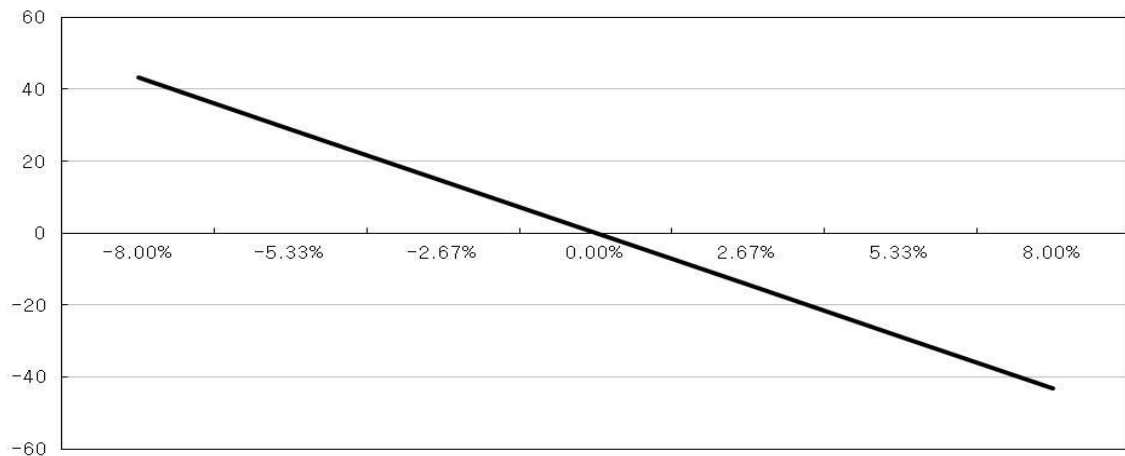
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	98	79	19	장내
누계	주식	주식	2,927	0	2,927	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,109	-1,109	장내
합계			2,927	1,109	1,818	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

315

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

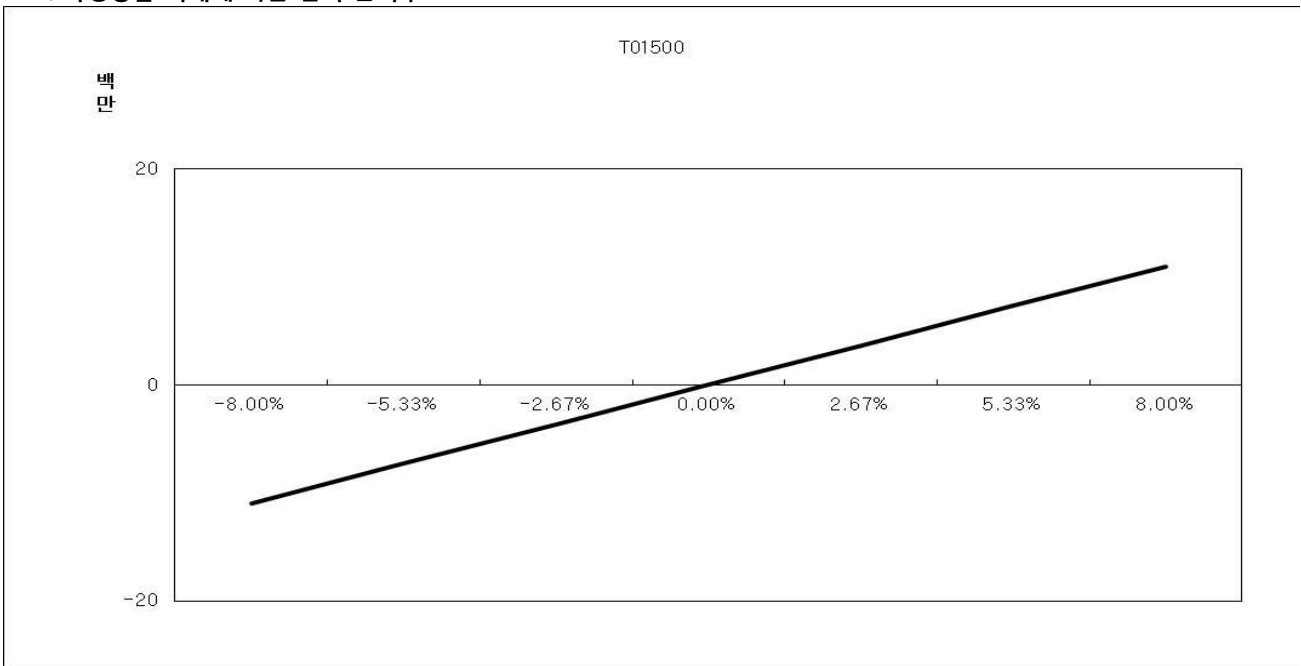
공시일: 2020-07-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	11	0	11	장내
누계	주식	주식	554	0	554	장내
신규	주가지수	스왑	6,297	52	6,245	장외
누계	주가지수	스왑	49,956	3,882	46,074	장외
합계			50,510	3,882	46,627	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,953