

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-15

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	145	0	145	장내
신규	주식	주식	1	0	1	장내
누계	주식	주식	7,153	0	7,153	장내
합계			7,298	0	7,298	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

971

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	51	-51	장내
누계	주식	주식	2,960	0	2,960	장내
신규	유가증권	선물	137	137	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,207	-1,207	장내
합계			2,960	1,207	1,753	

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)

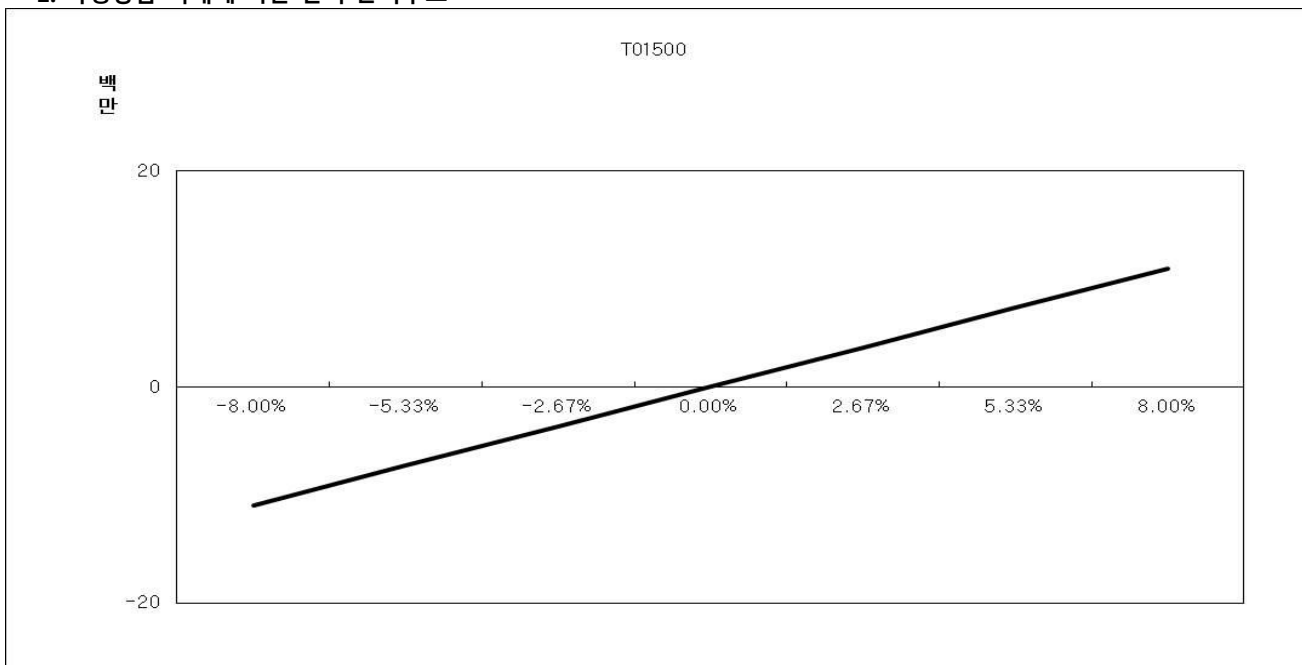
공시일: 2020-07-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	34	63	-29	장내
누계	주식	주식	560	0	560	장내
신규	주가지수	스왑	2,105	48	2,057	장외
누계	주가지수	스왑	52,346	4,102	48,244	장외
합계			52,906	4,102	48,803	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,079