

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-16

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	146	0	146	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	7,222	0	7,222	장내
합계			7,368	0	7,368	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

980

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

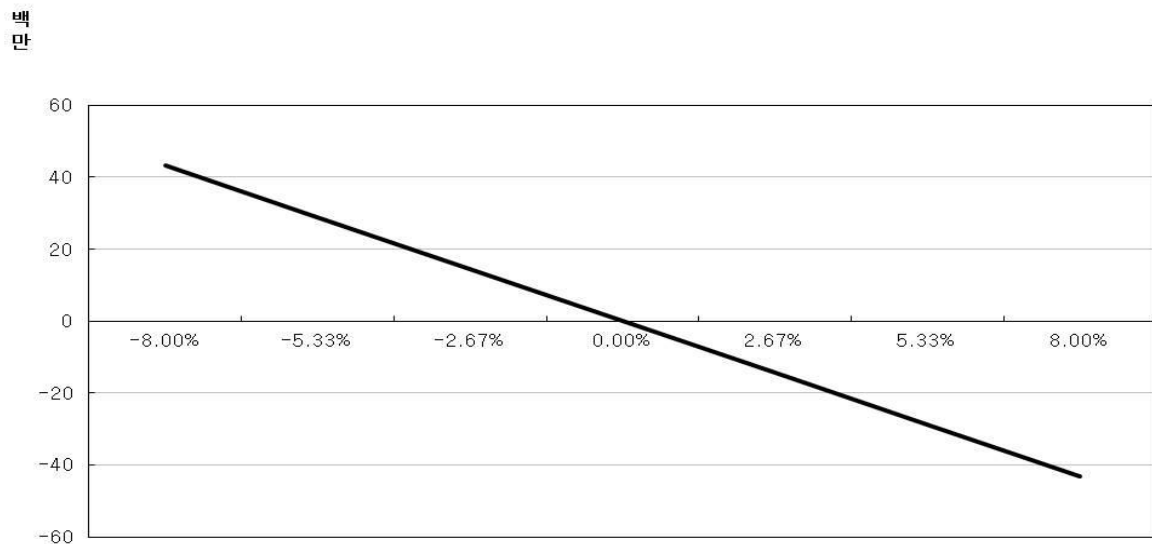
공시일: 2020-07-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	61	32	29	장내
누계	주식	주식	2,996	0	2,996	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,204	-1,204	장내
합계			2,996	1,204	1,792	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

322

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

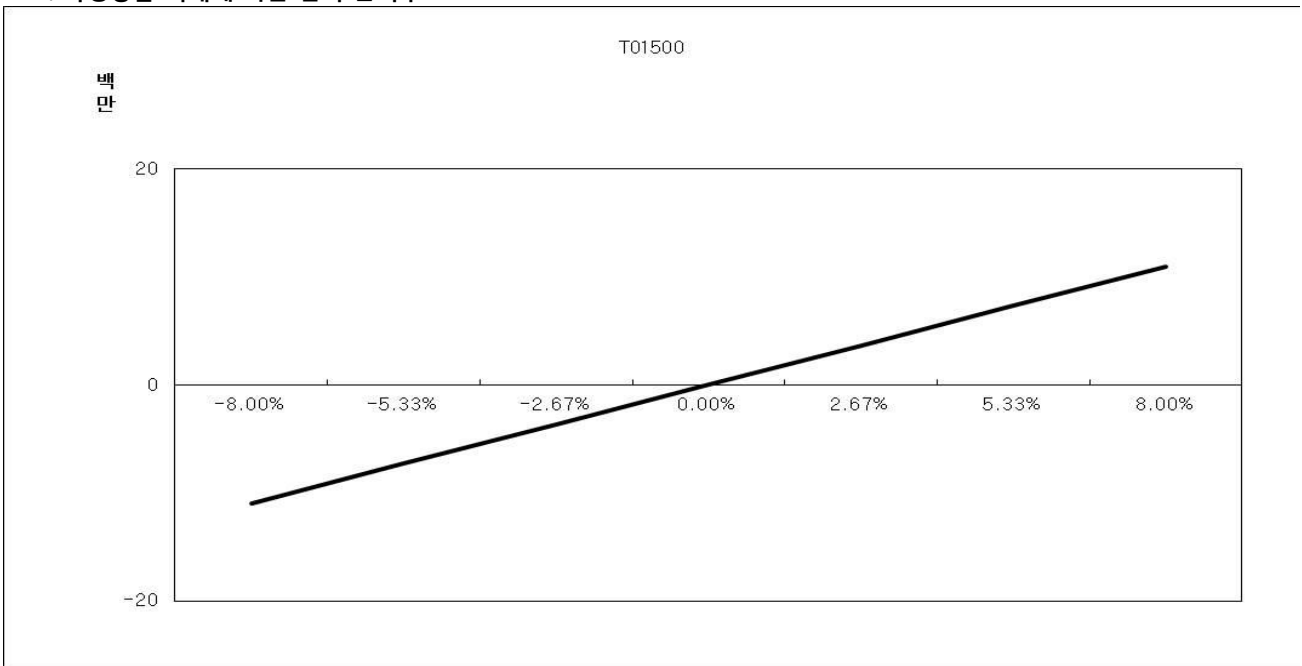
공시일: 2020-07-16

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	562	0	562	장내
신규	주가지수	스왑	309	197	112	장외
누계	주가지수	스왑	52,395	4,254	48,142	장외
합계			52,957	4,254	48,703	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,086