

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-17

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	0	0	0	장내
누계	주식	주식	7,146	0	7,146	장내
합계			7,291	0	7,291	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

970

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-07-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	93	36	58	장내
누계	주식	주식	3,060	0	3,060	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,191	-1,191	장내
합계			3,060	1,191	1,869	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

336

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-07-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	18	-18	장내
누계	주식	주식	539	0	539	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	52,541	4,189	48,352	장외
합계			53,080	4,189	48,891	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,099