펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

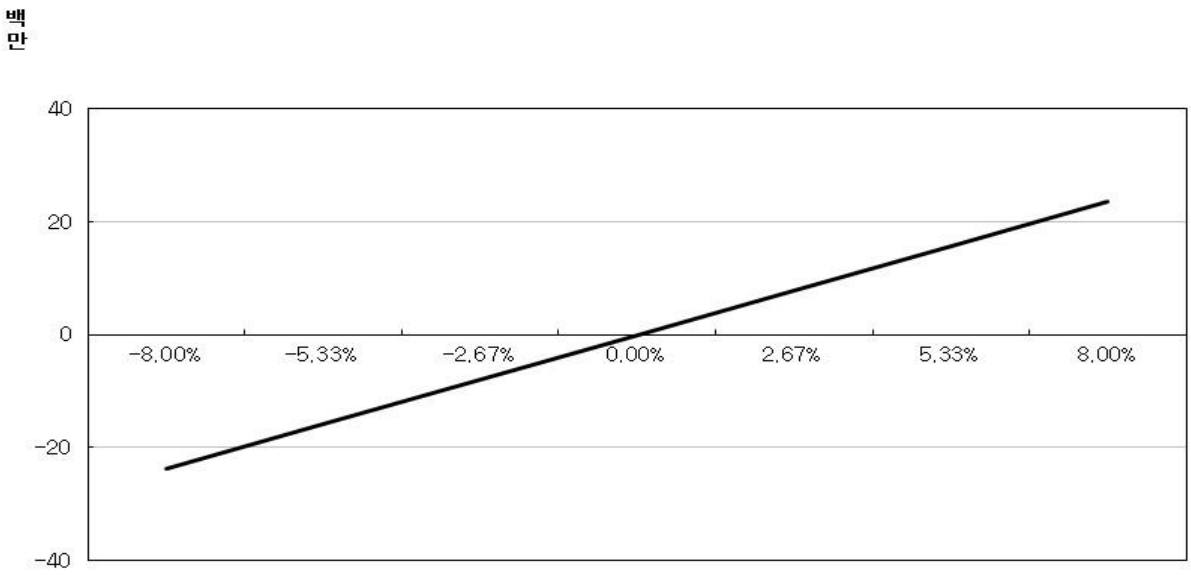
공시일: 2020-08-18

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	1,038	0	1,038	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	7,870	0	7,870	장내
합계			8,907	0	8,907	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	83

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,133

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

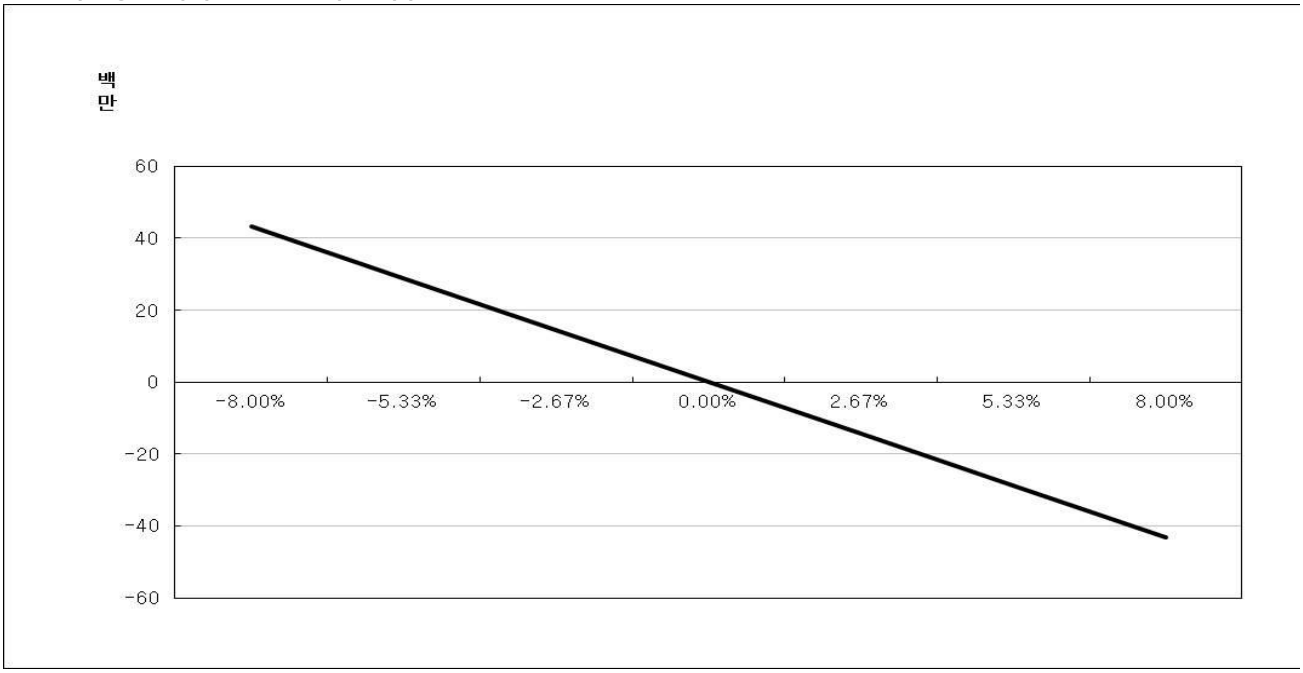
공시일: 2020-08-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	213	-213	장내
누계	주식	주식	3,390	0	3,390	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,266	-1,266	장내
합계			3,390	1,266	2,125	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

22

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

366

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

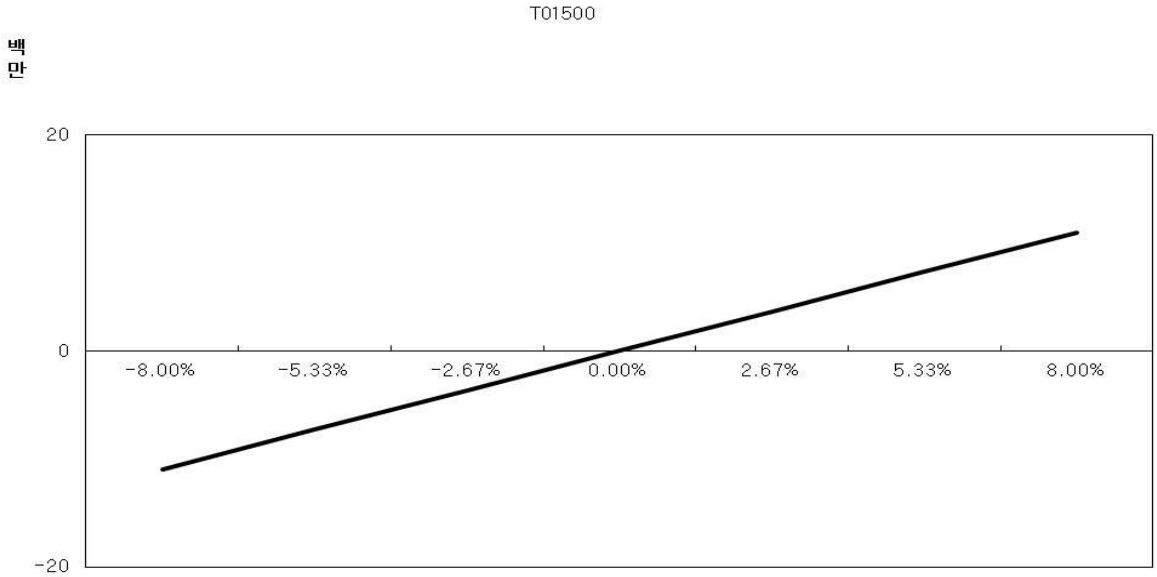
공시일: 2020-08-18

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	600	0	600	장내
신규	주가지수	스왑	15,205	0	15,205	장외
누계	주가지수	스왑	70,270	4,314	65,956	장외
합계			70,870	4,314	66,556	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,817