

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-09-16

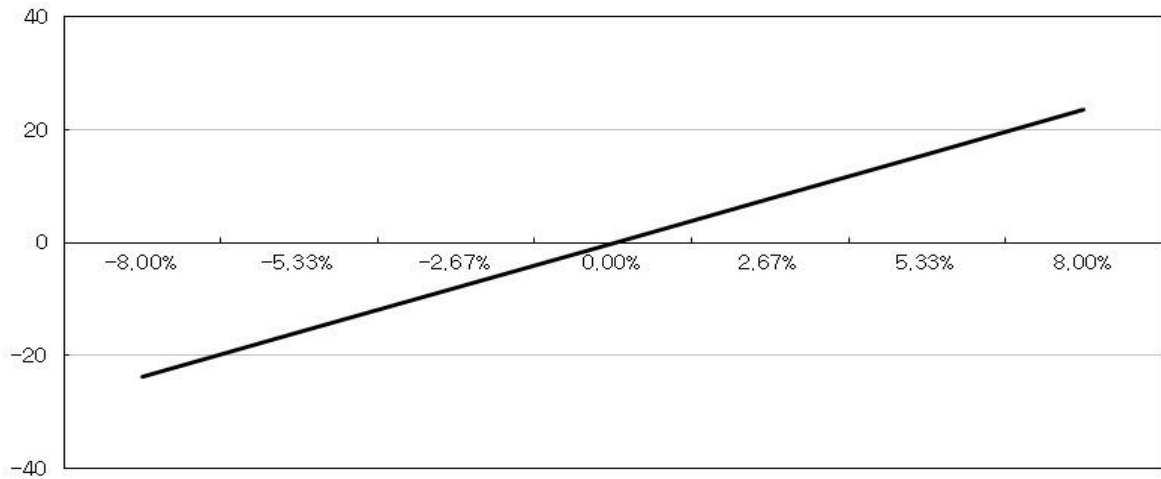
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	808	0	808	장내
신규	주식	주식	3	4	-1	장내
누계	주식	주식	8,163	0	8,163	장내
합계			8,971	0	8,971	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,167

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

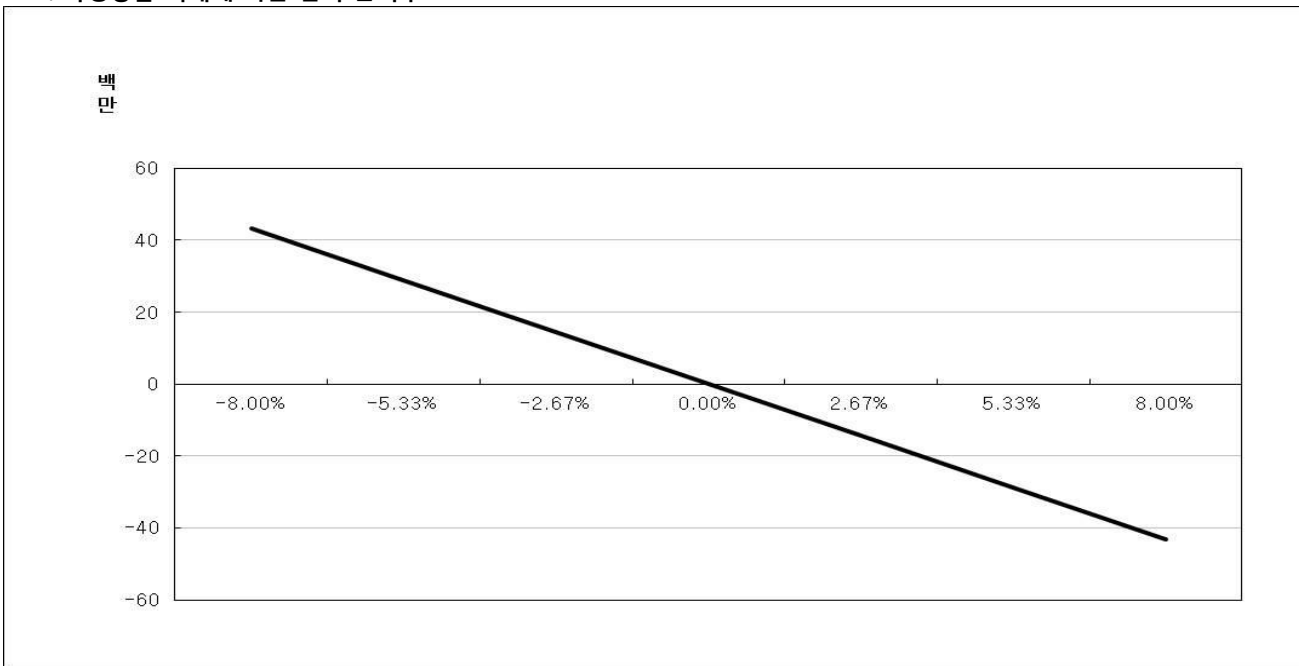
공시일: 2020-09-16

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	258	175	83	장내
누계	주식	주식	3,536	0	3,536	장내
신규	유가증권	선물	76	111	-35	장내
누계	유가증권	선물	0	1,273	-1,273	장내
합계			3,536	1,273	2,263	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

319

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

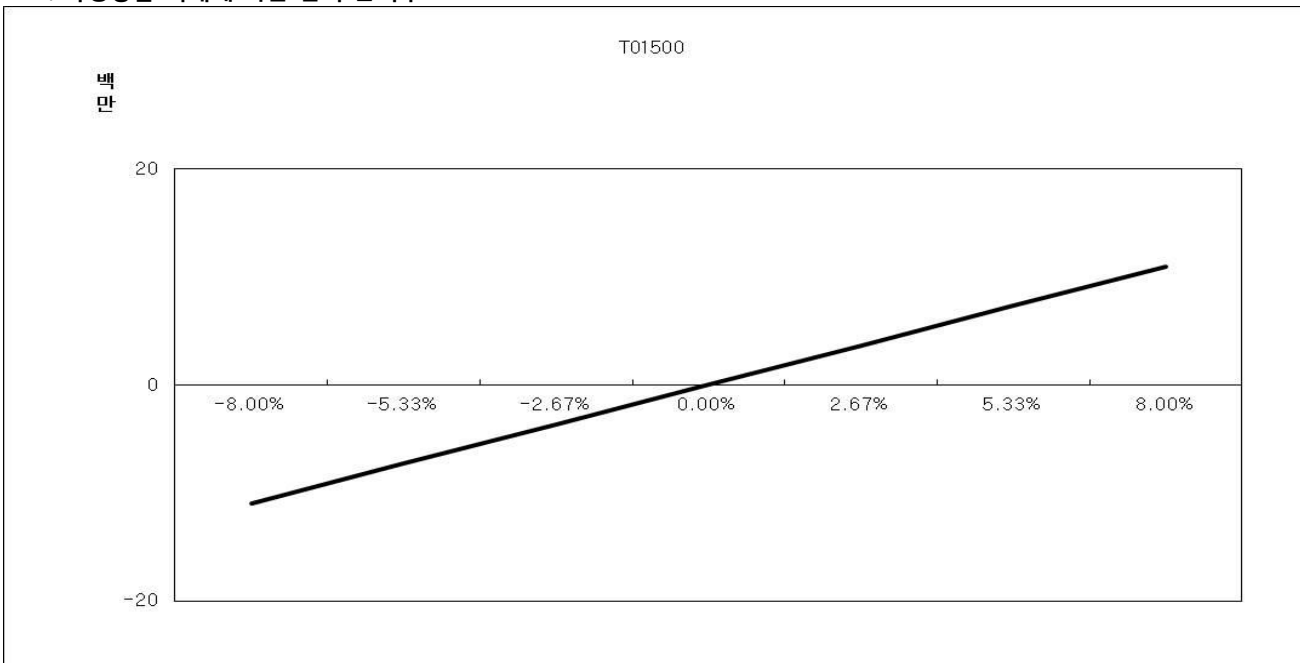
공시일: 2020-09-16

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	601	0	601	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	72,076	4,476	67,600	장외
합계			72,677	4,476	68,201	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,860