

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-10-14

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	799	0	799	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	8,077	0	8,077	장내
합계			8,876	0	8,876	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,159

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-10-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	45	0	45	장내
누계	주식	주식	3,063	0	3,063	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,272	-1,272	장내
합계			3,063	1,272	1,791	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

239

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-10-14

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	591	0	591	장내
신규	주가지수	스왑	79	19	60	장외
누계	주가지수	스왑	76,522	4,459	72,063	장외
합계			77,113	4,459	72,654	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

20

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,081