

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-10-21

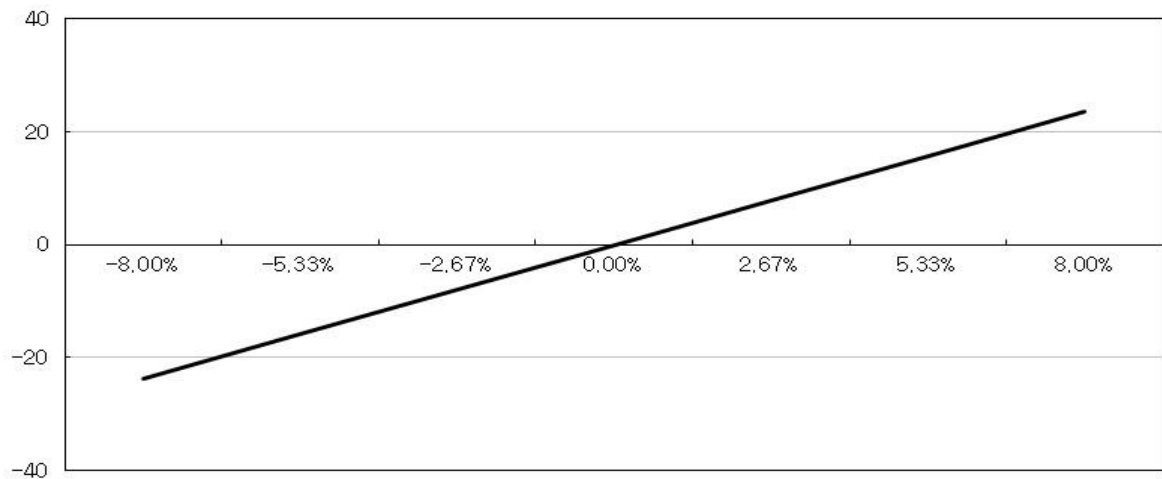
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	787	0	787	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	7,949	0	7,949	장내
합계			8,735	0	8,735	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

63

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,140

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-10-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	21	96	-75	장내
누계	주식	주식	3,405	0	3,405	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,239	-1,239	장내
합계			3,405	1,239	2,167	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

277

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-10-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	23	-23	장내
누계	주식	주식	563	0	563	장내
신규	주가지수	스왑	77	31	46	장외
누계	주가지수	스왑	75,901	4,291	71,610	장외
합계			76,464	4,291	72,173	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,057