

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-11-09

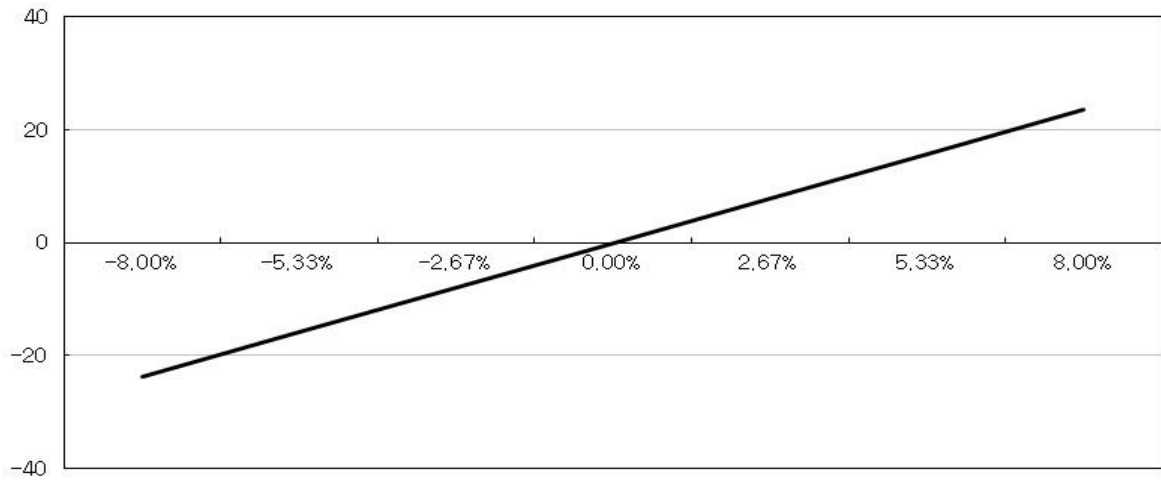
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	725	0	725	장내
신규	주식	주식	0	2	-2	장내
누계	주식	주식	8,155	0	8,155	장내
합계			8,880	0	8,880	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

58

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,185

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

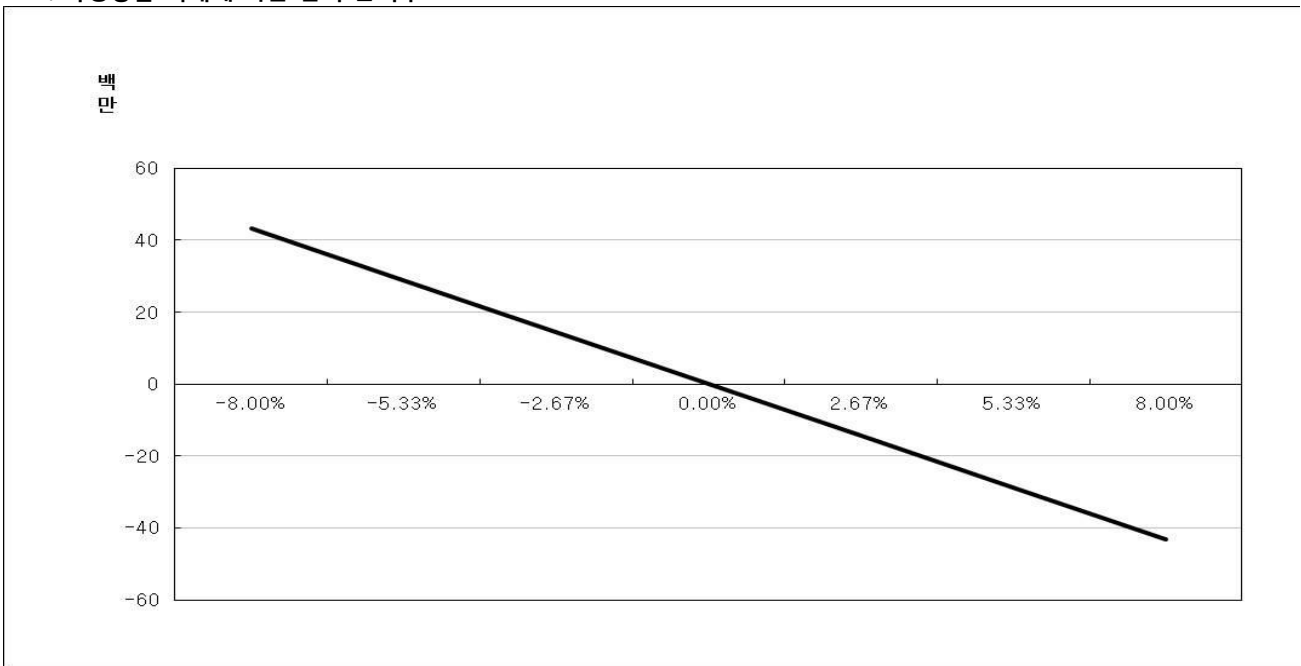
공시일: 2020-11-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	48	482	-434	장내
누계	주식	주식	3,198	0	3,198	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,258	-1,258	장내
합계			3,198	1,258	1,940	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

266

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-11-09

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	500	0	500	장내
신규	주가지수	스왑	0	5,246	-5,246	장외
누계	주가지수	스왑	69,407	4,222	65,185	장외
합계			69,907	4,222	65,685	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,799