

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-11-17

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	766	0	766	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	8,622	0	8,622	장내
합계			9,388	0	9,388	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,258

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

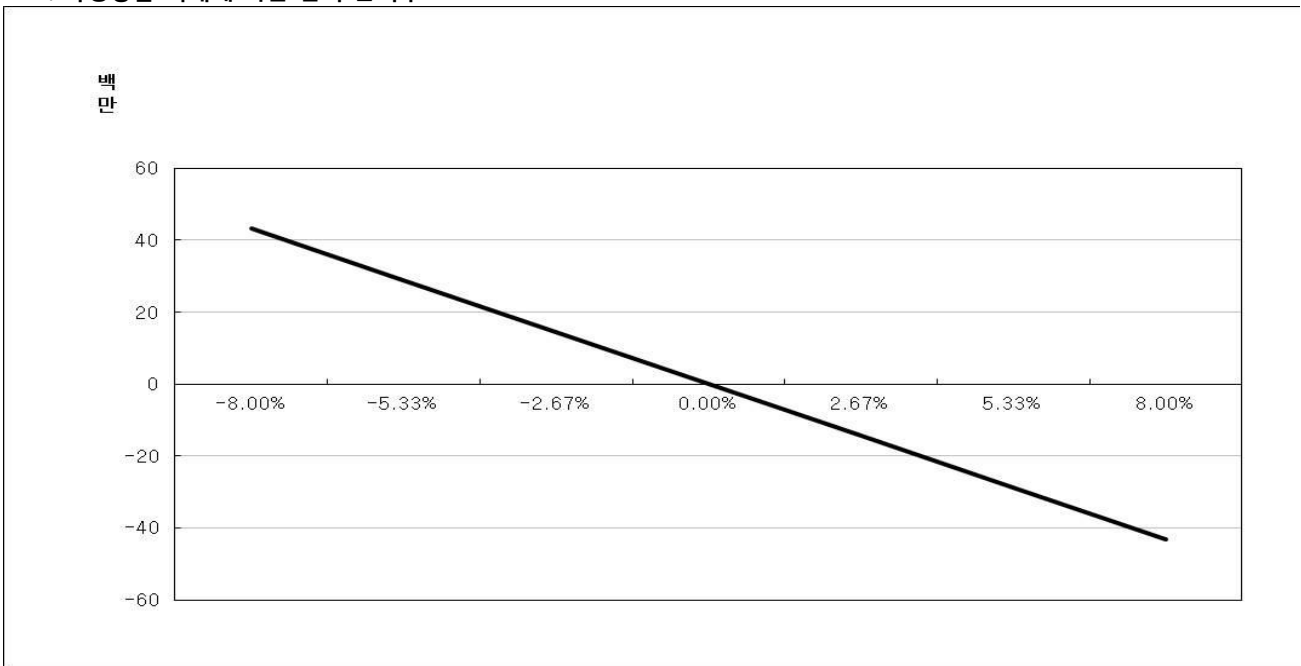
공시일: 2020-11-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	66	605	-539	장내
누계	주식	주식	3,556	0	3,556	장내
신규	유가증권	선물	112	131	-19	장내
누계	유가증권	선물	0	1,291	-1,291	장내
합계			3,556	1,291	2,264	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

328

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-11-17

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	532	0	532	장내
신규	주가지수	스왑	0	97	-97	장외
누계	주가지수	스왑	68,930	4,195	64,735	장외
합계			69,463	4,195	65,268	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,756