

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-12-29

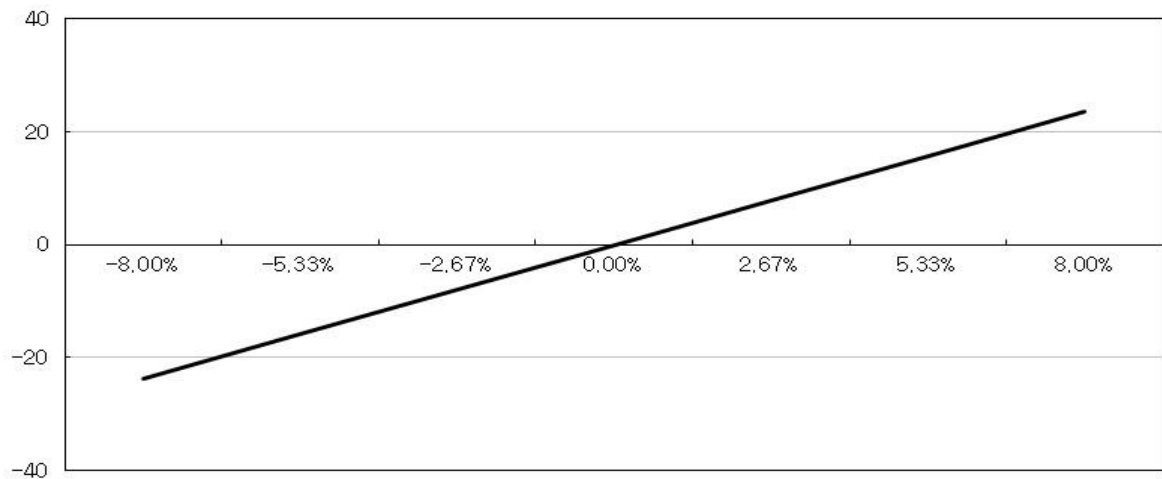
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	570	0	570	장내
신규	주식	주식	32	4	29	장내
누계	주식	주식	9,791	0	9,791	장내
합계			10,361	0	10,361	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

45

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,430

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

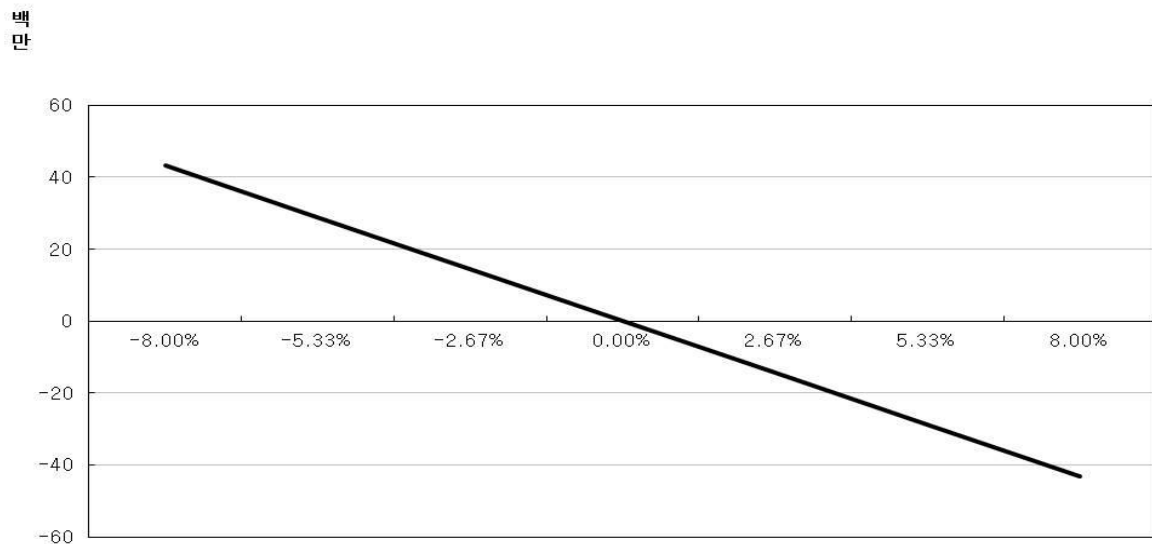
공시일: 2020-12-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	147	0	147	장내
누계	주식	주식	4,036	0	4,036	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,330	-1,330	장내
합계			4,036	1,330	2,706	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

383

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-12-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	12	-12	장내
누계	주식	주식	680	0	680	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	60	-60	장내
신규	주가지수	스왑	2,736	9	2,727	장외
누계	주가지수	스왑	72,433	4,255	68,178	장외
합계			73,113	4,315	68,797	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,931