

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-12-30

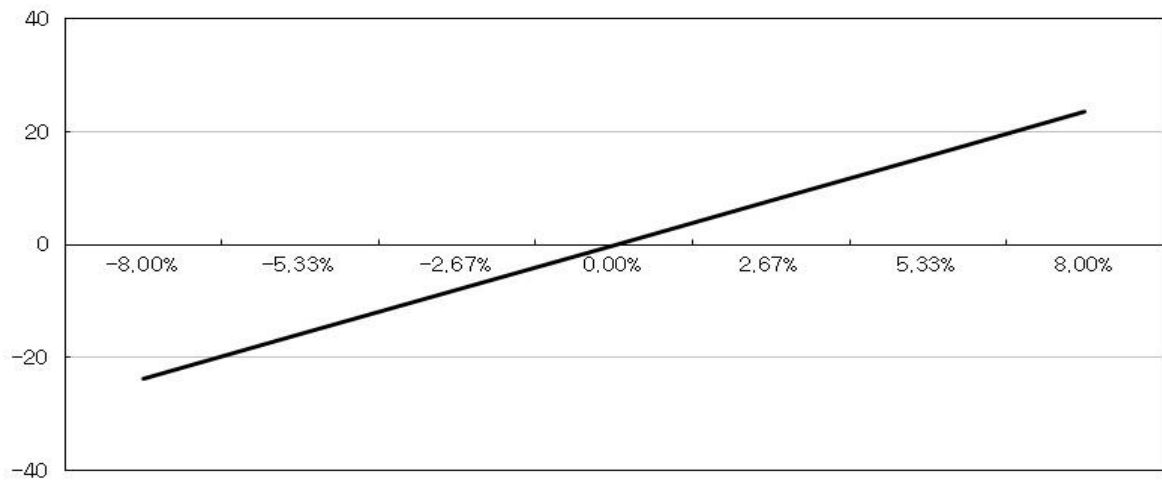
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	95	-95	장내
누계	주가지수	선물	477	0	477	장내
신규	주식	주식	0	31	-31	장내
누계	주식	주식	9,783	0	9,783	장내
합계			10,259	0	10,259	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

38

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,424

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

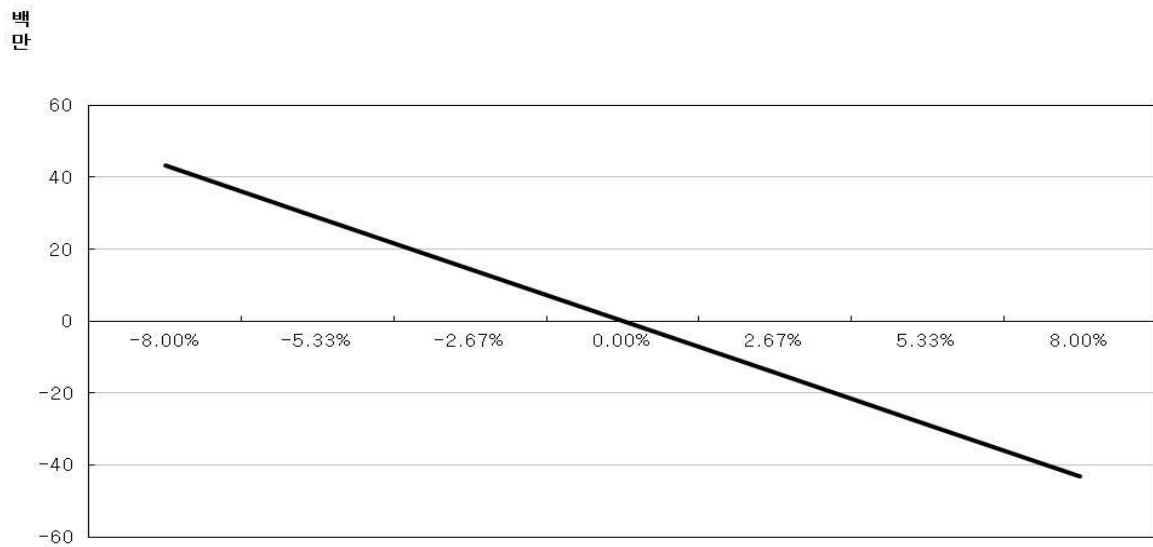
공시일: 2020-12-30

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	67	0	67	장내
누계	주식	주식	4,078	0	4,078	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,338	-1,338	장내
합계			4,078	1,338	2,740	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

391

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

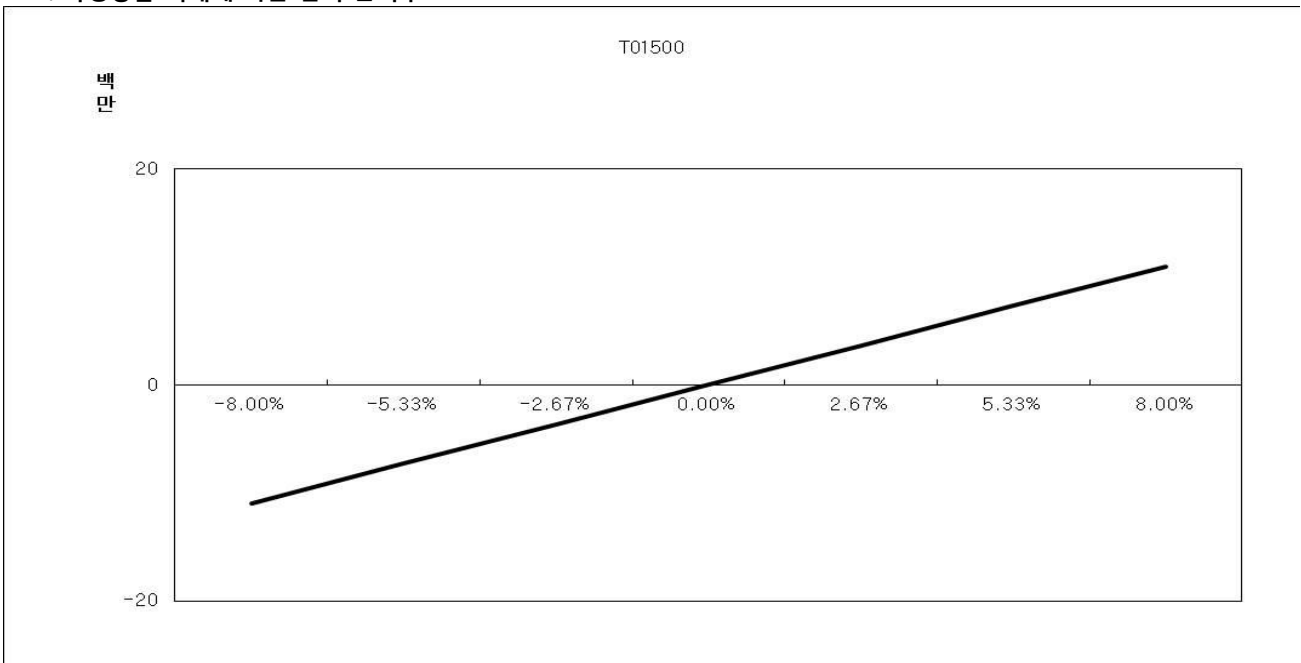
공시일: 2020-12-30

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	679	0	679	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	60	-60	장내
신규	주가지수	스왑	10	18	-8	장외
누계	주가지수	스왑	72,148	4,259	67,889	장외
합계			72,827	4,319	68,508	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,915