

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-12-31

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	487	0	487	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	9,989	0	9,989	장내
합계			10,476	0	10,476	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

39

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,459

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-12-31

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	4,101	0	4,101	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,354	-1,354	장내
합계			4,101	1,354	2,747	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

392

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-12-31

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	685	0	685	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	60	-60	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	71,788	4,277	67,512	장외
합계			72,474	4,337	68,137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,906