펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

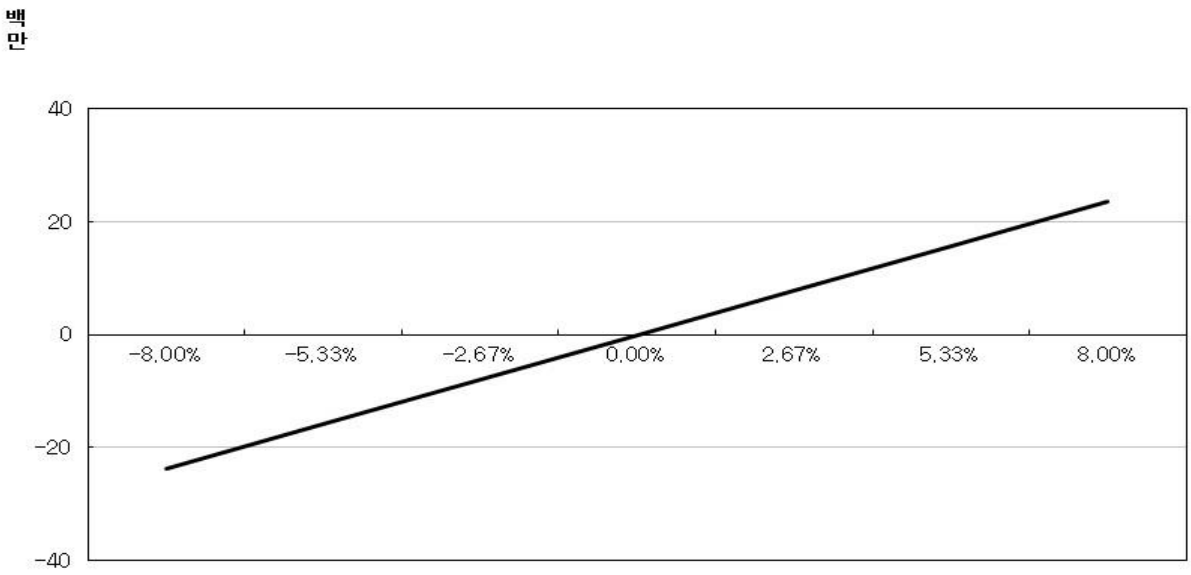
공시일: 2021-01-07

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	503	0	503	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,328	0	10,328	장내
합계			10,831	0	10,831	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	40

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,514

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

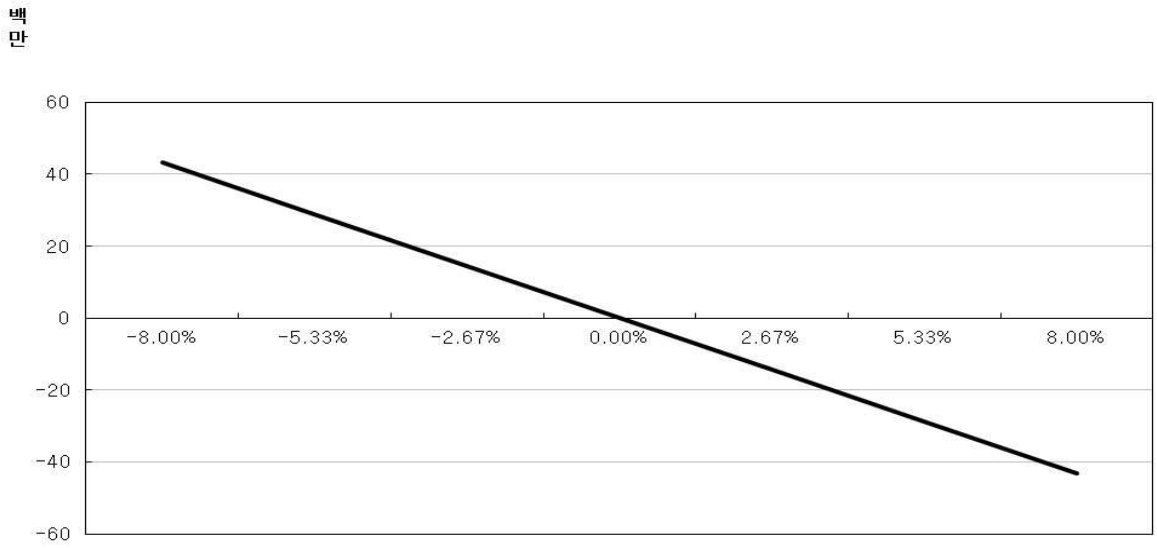
공시일: 2021-01-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	14	65	-50	장내
누계	주식	주식	3,950	0	3,950	장내
신규	유가증권	선물	0	74	-74	장내
누계	유가증권	선물	0	1,374	-1,374	장내
합계			3,950	1,374	2,576	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	356

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

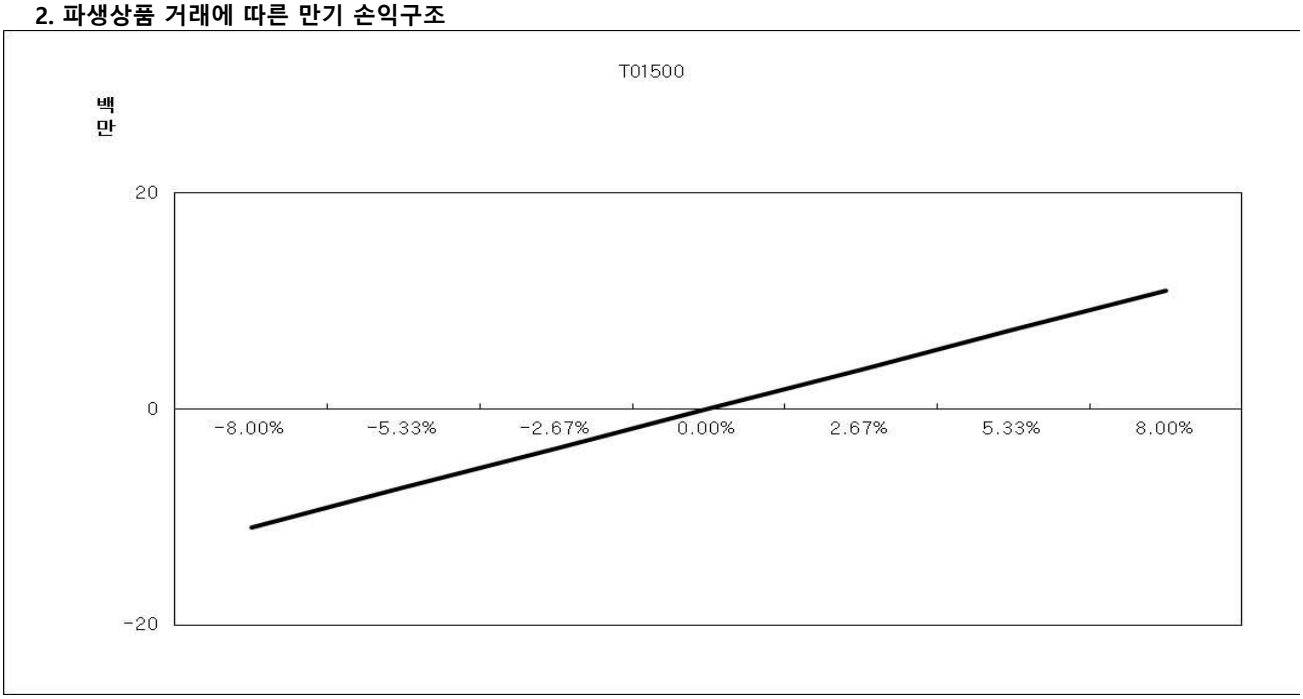
공시일: 2021-01-07

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	674	0	674	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	71,867	4,335	67,532	장외
합계			72,541	4,395	68,146	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,893