

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	108	-108	장내
누계	주가지수	선물	430	0	430	장내
신규	주식	주식	22	0	22	장내
누계	주식	주식	11,055	0	11,055	장내
합계			11,485	0	11,485	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,622

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	11	12	0	장내
누계	주식	주식	4,188	0	4,188	장내
신규	유가증권	선물	133	0	133	장내
누계	유가증권	선물	0	1,280	-1,280	장내
합계			4,188	1,280	2,907	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

381

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

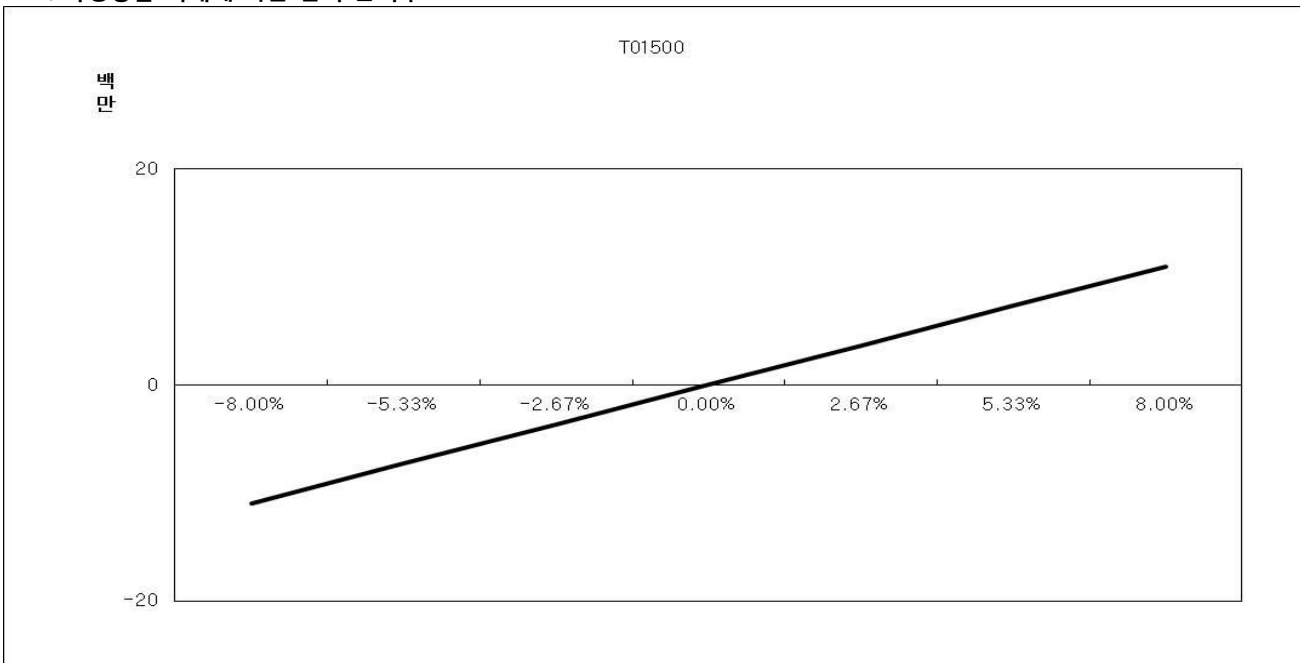
공시일: 2021-01-11

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	697	0	697	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	61	-61	장내
신규	주가지수	스왑	8,376	8,399	-22	장외
누계	주가지수	스왑	72,188	4,381	67,807	장외
합계			72,885	4,442	68,442	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,886