

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-18

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	420	0	420	장내
신규	주식	주식	41	0	41	장내
누계	주식	주식	10,847	0	10,847	장내
합계			11,268	0	11,268	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,584

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	740	-740	장내
누계	주식	주식	3,227	0	3,227	장내
신규	유가증권	선물	0	144	-144	장내
누계	유가증권	선물	0	1,310	-1,310	장내
합계			3,227	1,310	1,916	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

246

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

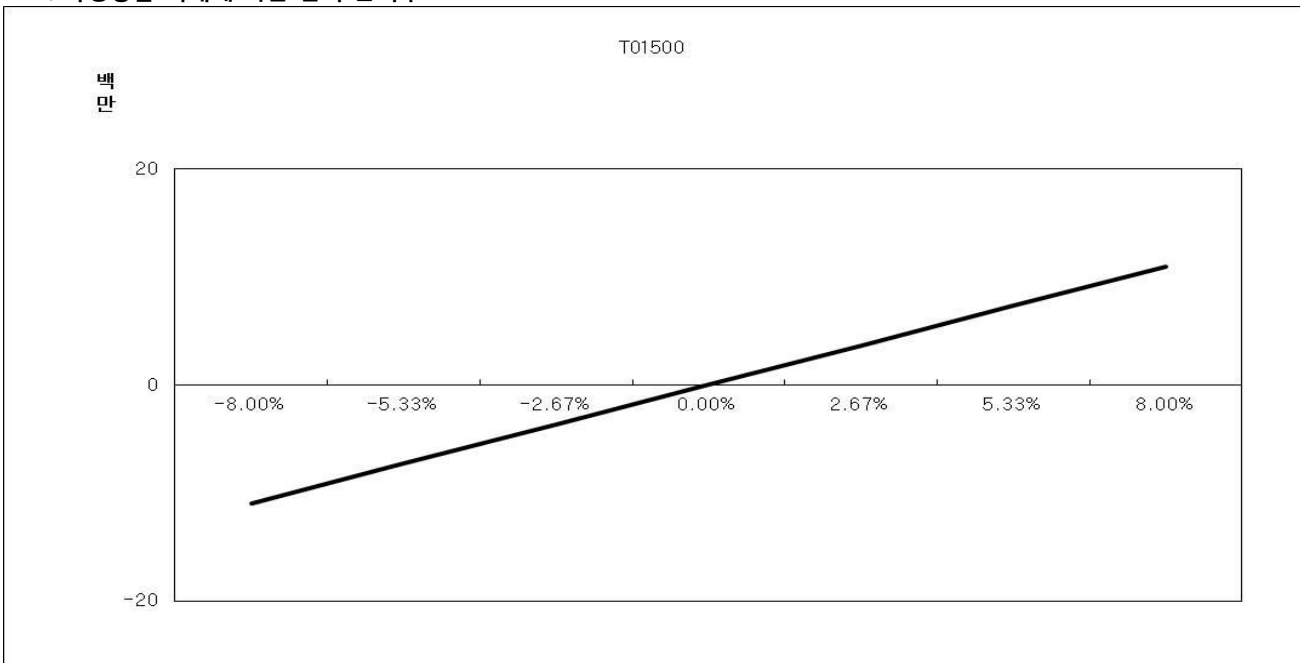
공시일: 2021-01-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	29	-29	장내
누계	주식	주식	659	0	659	장내
신규	유가증권	선물	0	46	-46	장내
누계	유가증권	선물	0	106	-106	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	72,822	4,288	68,534	장외
합계			73,480	4,394	69,087	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,923