

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-19

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	411	0	411	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,589	0	10,589	장내
합계			11,000	0	11,000	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,552

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-19

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	219	147	72	장내
누계	주식	주식	3,243	0	3,243	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,274	-1,274	장내
합계			3,243	1,274	1,969	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

257

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2021-01-19

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	642	0	642	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	104	-104	장내
신규	주가지수	스왑	42	72	-30	장외
누계	주가지수	스왑	73,038	4,262	68,776	장외
합계			73,680	4,366	69,314	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

5,510

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,947