펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

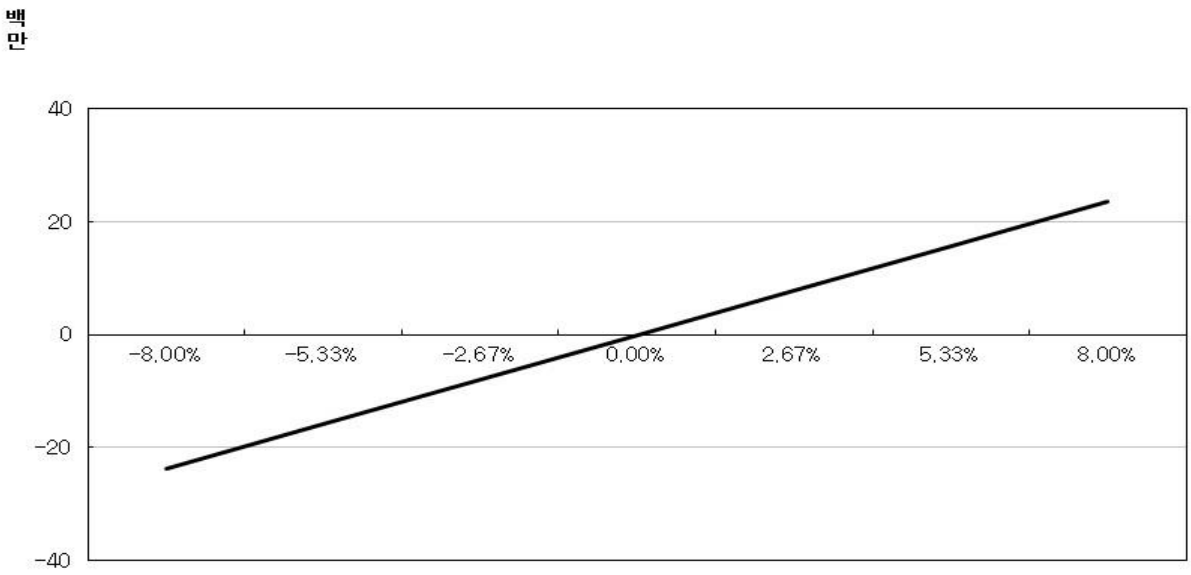
공시일: 2021-01-21

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	424	0	424	장내
신규	주식	주식	3	6	-3	장내
누계	주식	주식	10,876	0	10,876	장내
합계			11,300	0	11,300	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,605

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

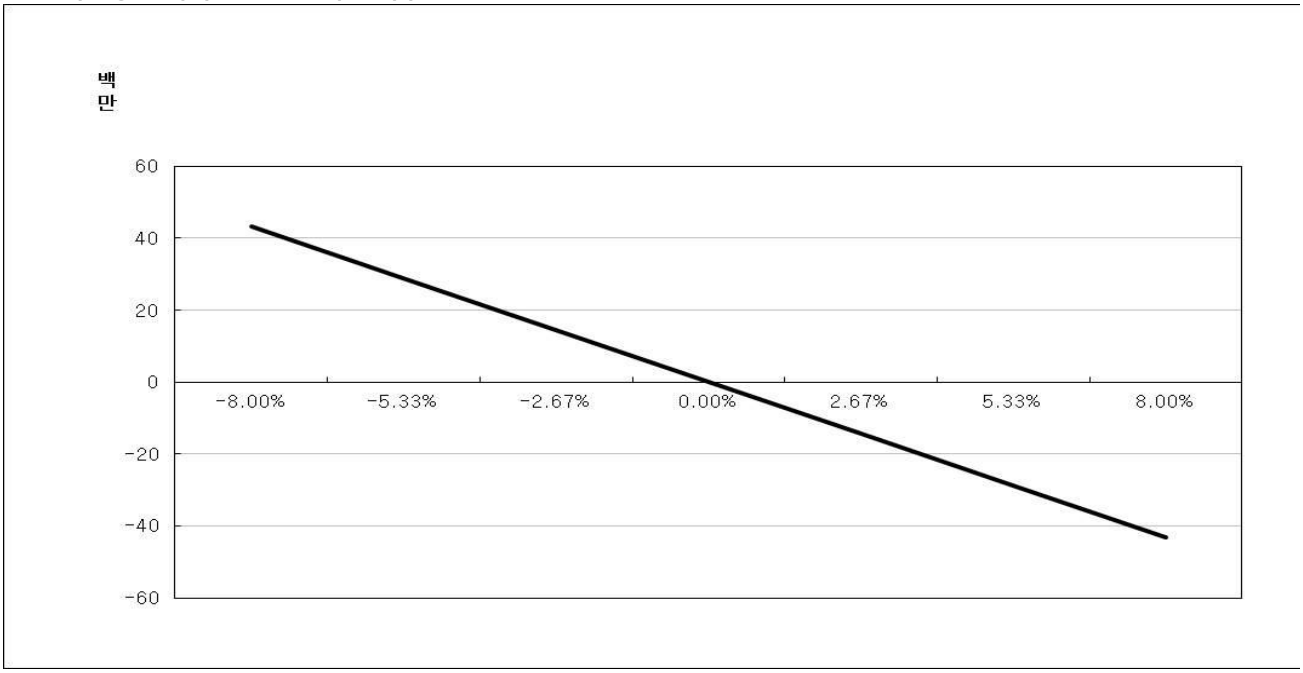
공시일: 2021-01-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	39	39	0	장내
누계	주식	주식	3,406	0	3,406	장내
신규	유가증권	선물	0	69	-69	장내
누계	유가증권	선물	0	1,383	-1,383	장내
합계			3,406	1,383	2,023	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	305

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

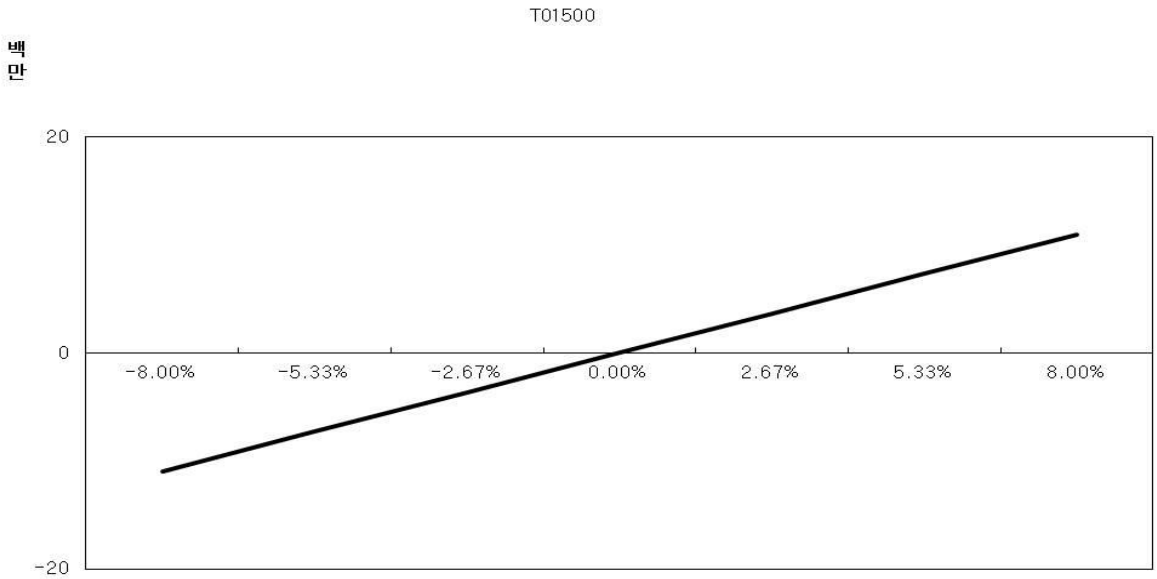
공시일: 2021-01-21

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	666	0	666	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	107	-107	장내
신규	주가지수	스왑	84	0	84	장외
누계	주가지수	스왑	4,360	4,312	48	장외
합계			5,027	4,419	608	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

229