펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

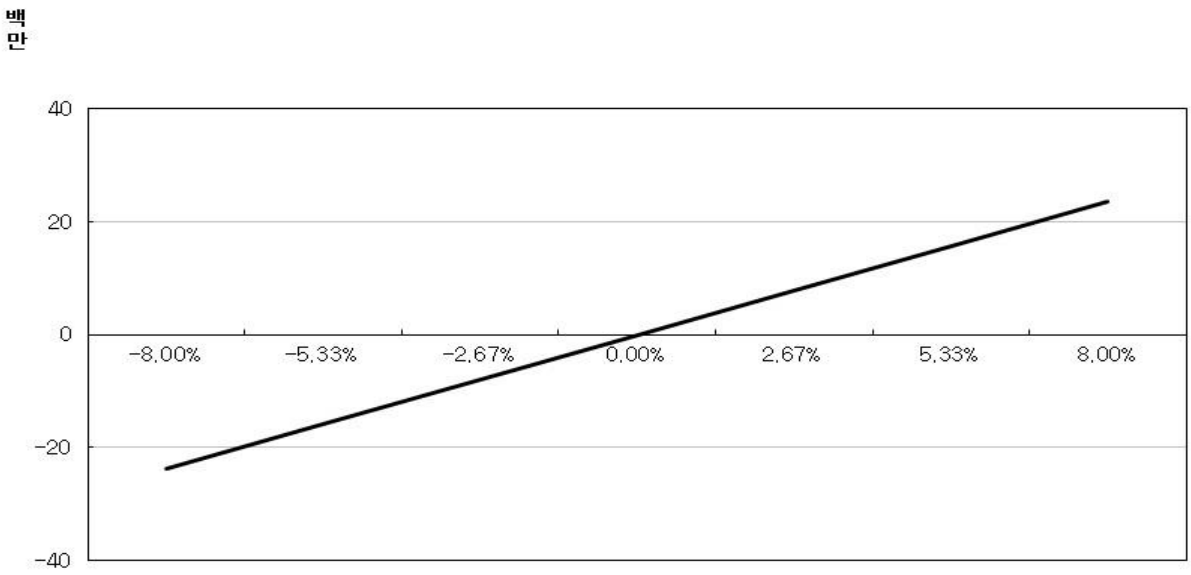
공시일: 2021-01-22

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	430	0	430	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,041	0	11,041	장내
합계			11,471	0	11,471	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,628

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

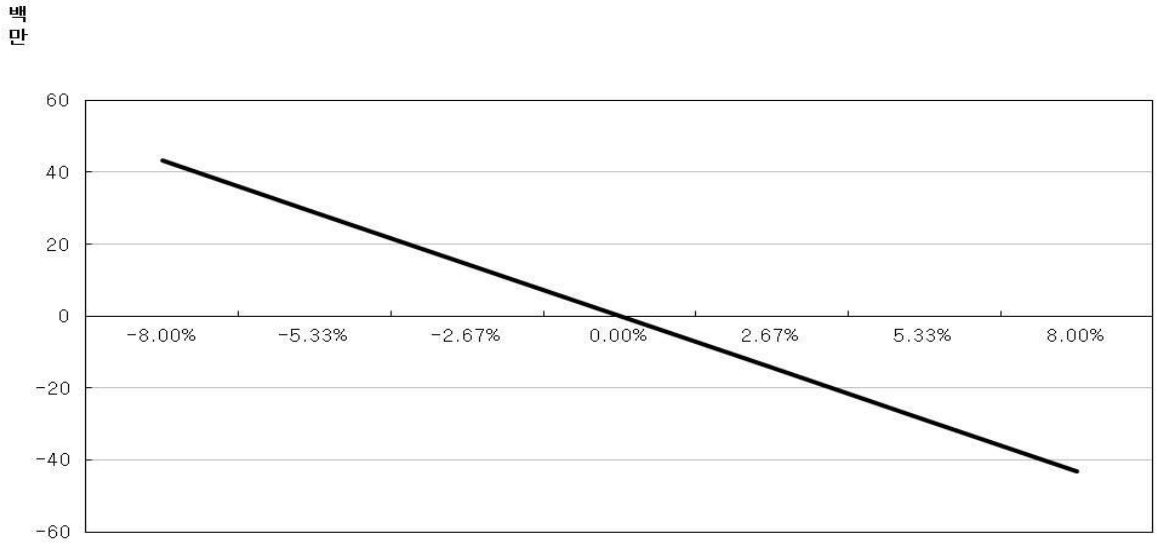
공시일: 2021-01-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	148	40	109	장내
누계	주식	주식	3,557	0	3,557	장내
신규	유가증권	선물	221	230	-9	장내
누계	유가증권	선물	0	1,420	-1,420	장내
합계			3,557	1,420	2,137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	15

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	320

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

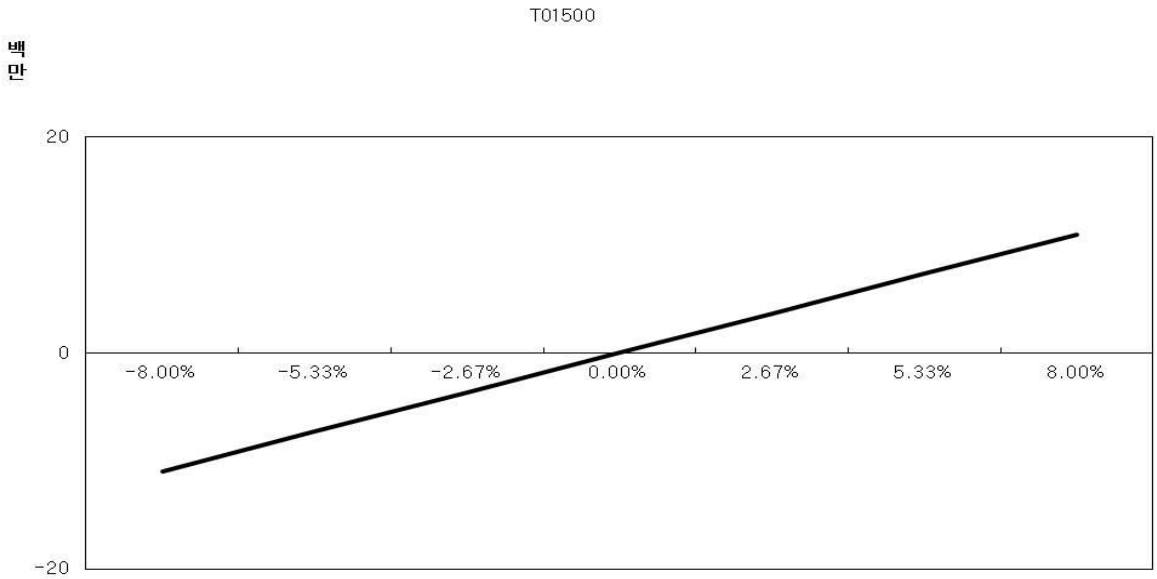
공시일: 2021-01-22

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	680	0	680	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	107	-107	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4,376	4,329	47	장외
합계			5,056	4,436	620	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

230