

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-28

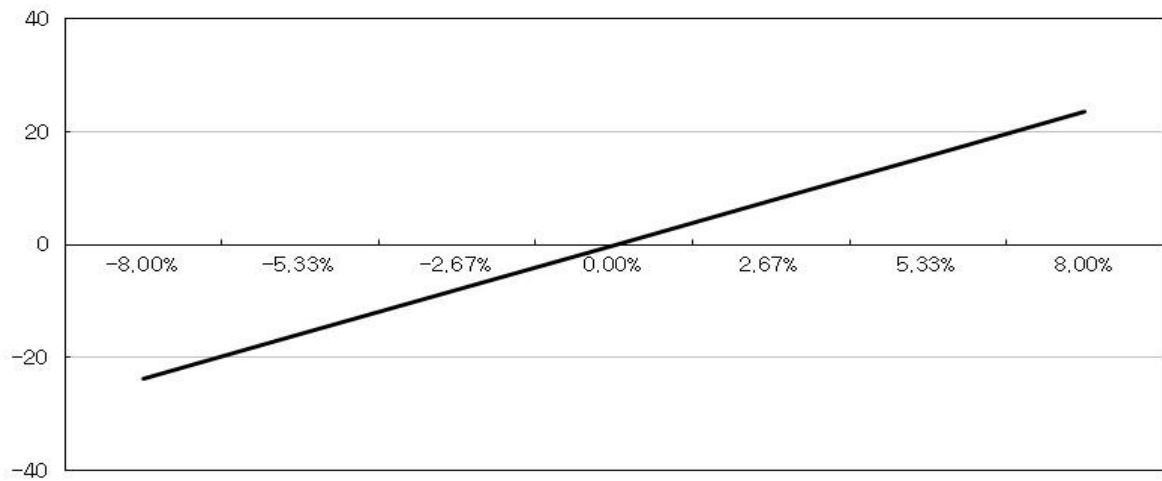
1. 계약금액

(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	2	1	2	장내
누계	주식	주식	10,842	0	10,842	장내
합계			11,266	0	11,266	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,590

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-28

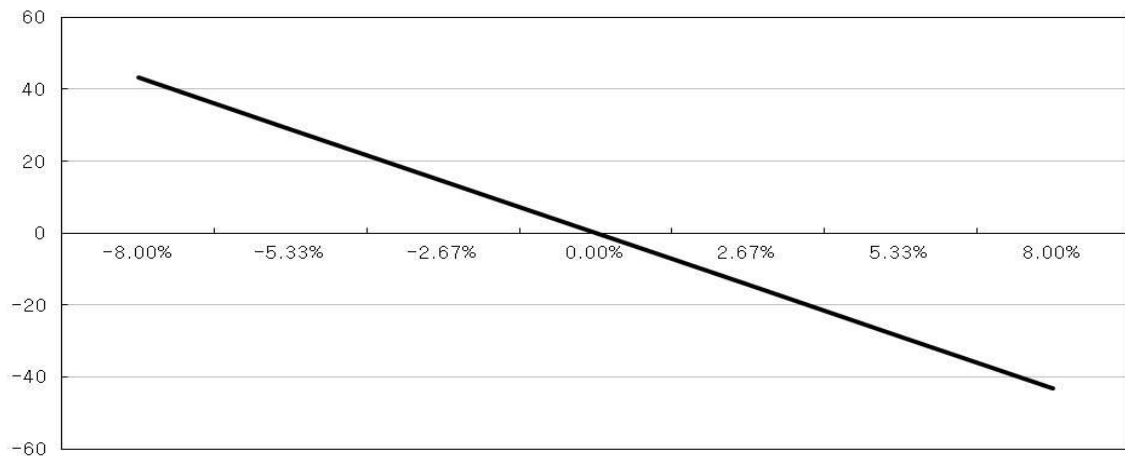
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	186	138	48	장내
누계	주식	주식	3,324	0	3,324	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,420	-1,420	장내
합계			3,324	1,420	1,904	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

281

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

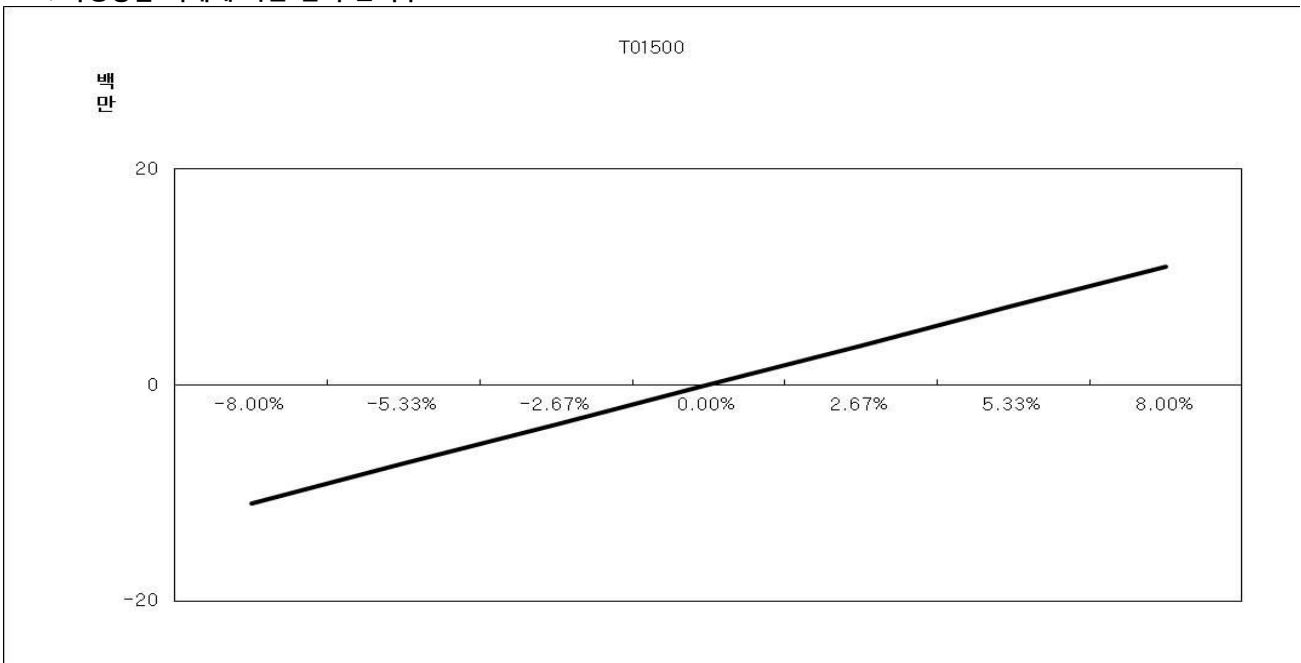
공시일: 2021-01-28

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	648	0	648	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	206	-206	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4,219	4,343	-124	장외
합계			4,867	4,549	318	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

222