

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-03-09

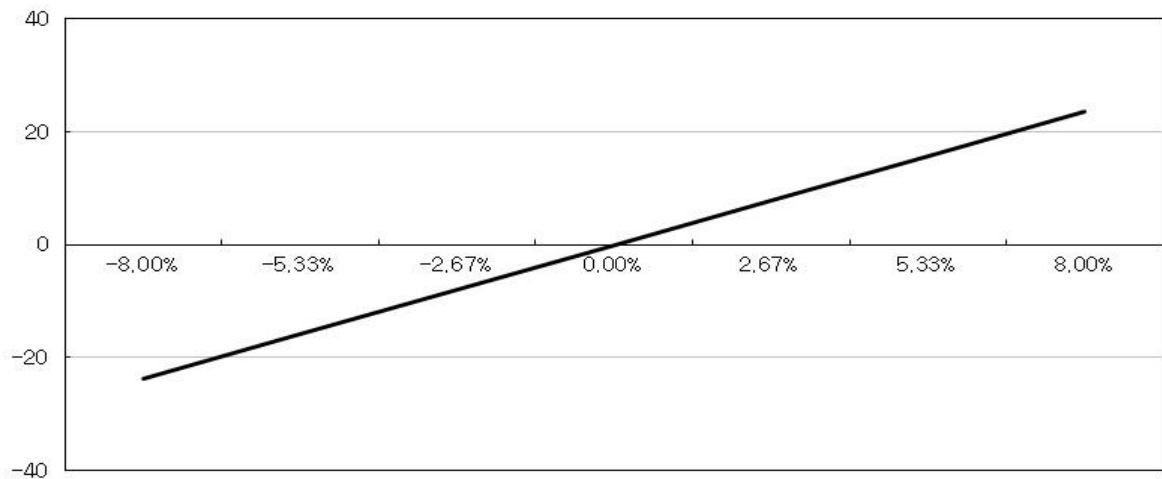
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	204	204	0	장내
누계	주가지수	선물	408	0	408	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,442	0	10,442	장내
합계			10,850	0	10,850	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,506

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-03-09

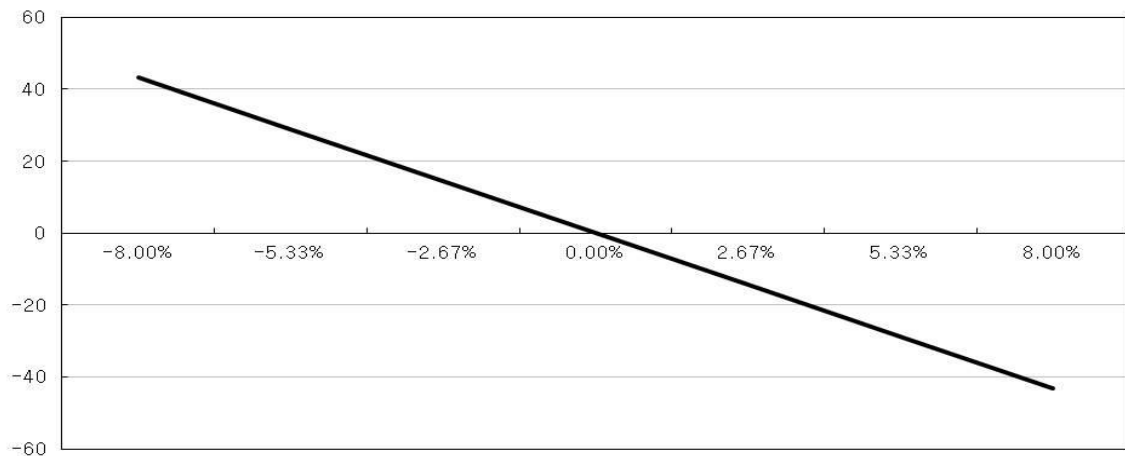
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	28	28	0	장내
누계	주식	주식	4,039	0	4,039	장내
신규	유가증권	선물	96	172	-76	장내
누계	유가증권	선물	0	1,313	-1,313	장내
합계			4,039	1,313	2,726	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

452

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

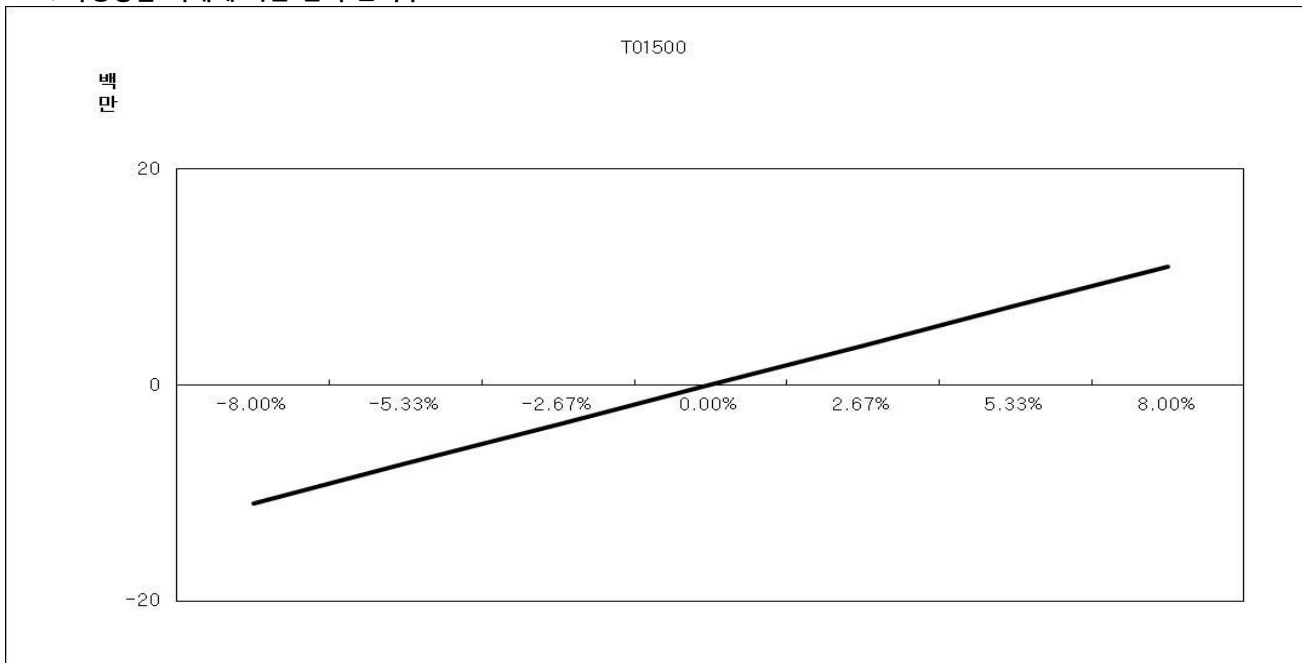
공시일: 2021-03-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	42	-42	장내
누계	주식	주식	745	0	745	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	373	-373	장내
신규	주가지수	스왑	7,933	7,902	31	장외
누계	주가지수	스왑	4,133	4,069	64	장외
합계			4,878	4,442	436	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

211