

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-03-26

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	306	0	306	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,509	0	10,509	장내
합계			10,815	0	10,815	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

24

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,110

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-03-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	328	58	269	장내
누계	주식	주식	4,182	0	4,182	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,332	-1,332	장내
합계			4,182	1,332	2,850	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

388

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

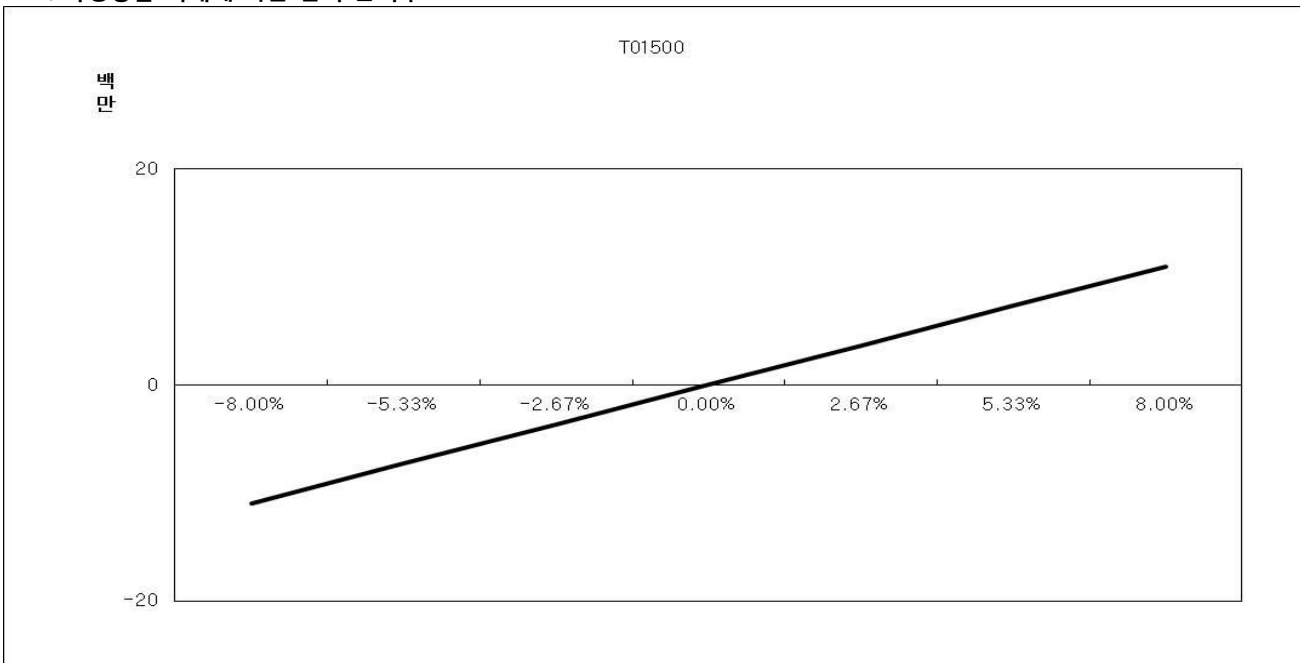
공시일: 2021-03-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	131	20	110	장내
누계	주식	주식	988	0	988	장내
신규	유가증권	선물	0	96	-96	장내
누계	유가증권	선물	0	544	-544	장내
신규	주가지수	스왑	263	285	-22	장외
누계	주가지수	스왑	3,788	4,012	-224	장외
합계			4,776	4,556	221	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

192