

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-03-29

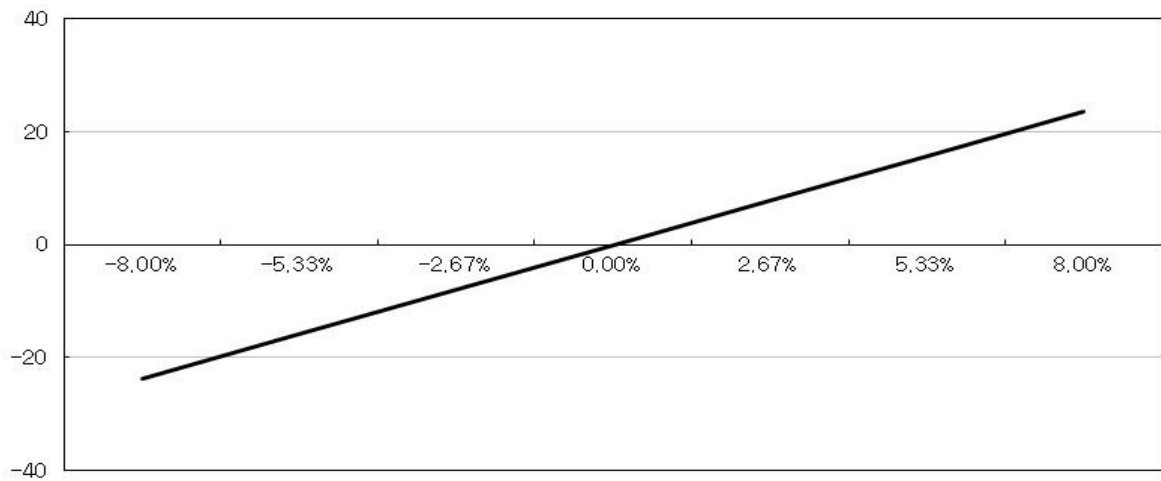
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	310	0	310	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,622	0	10,622	장내
합계			10,931	0	10,931	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,118

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

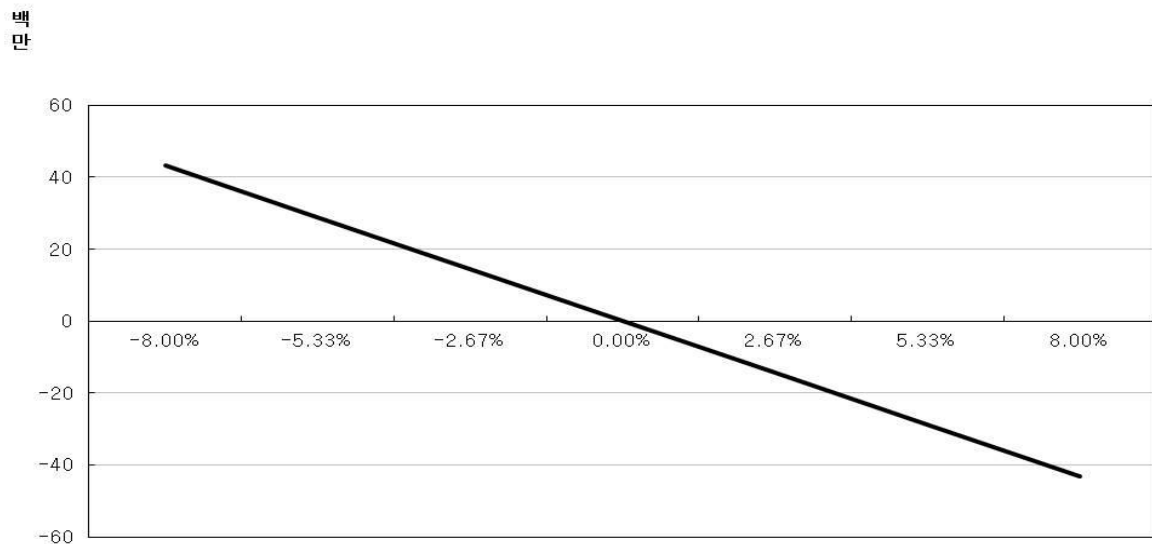
공시일: 2021-03-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	77	0	77	장내
누계	주식	주식	4,349	0	4,349	장내
신규	유가증권	선물	171	183	-12	장내
누계	유가증권	선물	0	1,350	-1,350	장내
합계			4,349	1,350	2,998	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

409

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2021-03-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	87	0	87	장내
누계	주식	주식	1,098	0	1,098	장내
신규	유가증권	선물	0	165	-165	장내
누계	유가증권	선물	0	710	-710	장내
신규	주가지수	스왑	213	110	103	장외
누계	주가지수	스왑	3,861	3,972	-111	장외
합계			4,959	4,682	277	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

197