

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-05

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	318	0	318	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,903	0	10,903	장내
합계			11,221	0	11,221	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,119

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	18	0	18	장내
누계	주식	주식	4,380	0	4,380	장내
신규	유가증권	선물	13	0	13	장내
누계	유가증권	선물	0	1,365	-1,365	장내
합계			4,380	1,365	3,015	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

394

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

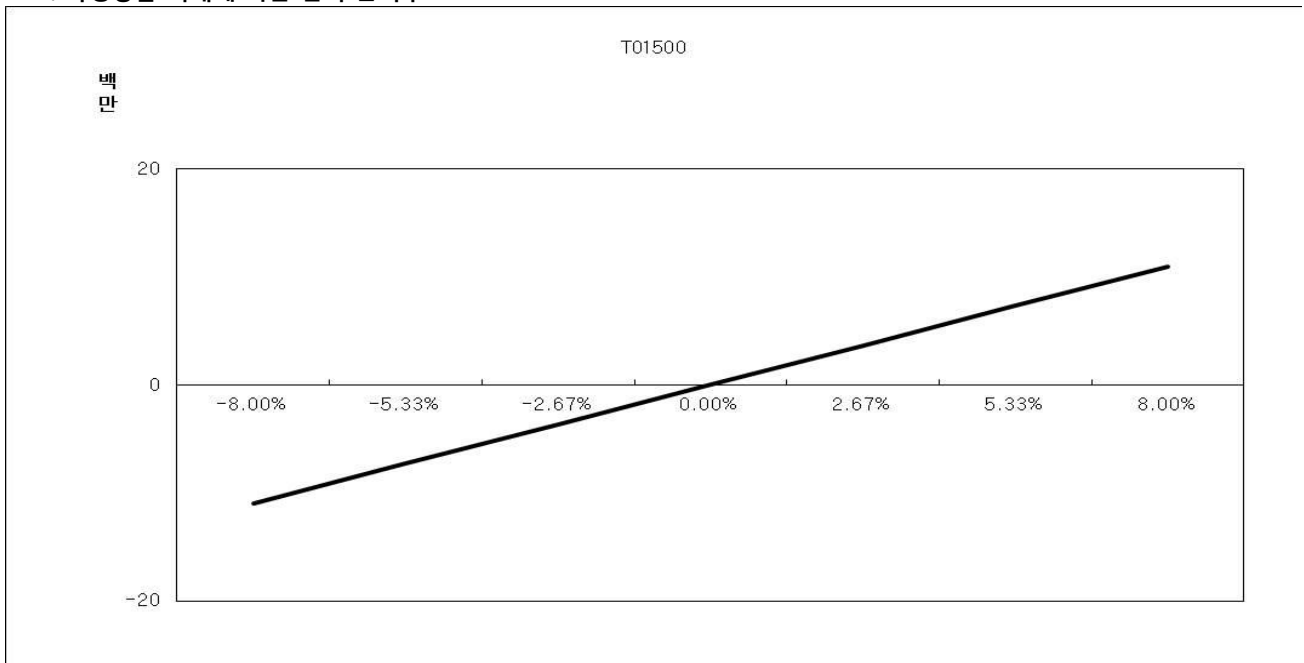
공시일: 2021-04-05

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	1,105	0	1,105	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	715	-715	장내
신규	주가지수	스왑	14	20	-6	장외
누계	주가지수	스왑	3,974	4,096	-123	장외
합계			5,079	4,811	267	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

215