

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-08

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	320	0	320	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,977	0	10,977	장내
합계			11,297	0	11,297	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

26

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,096

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-08

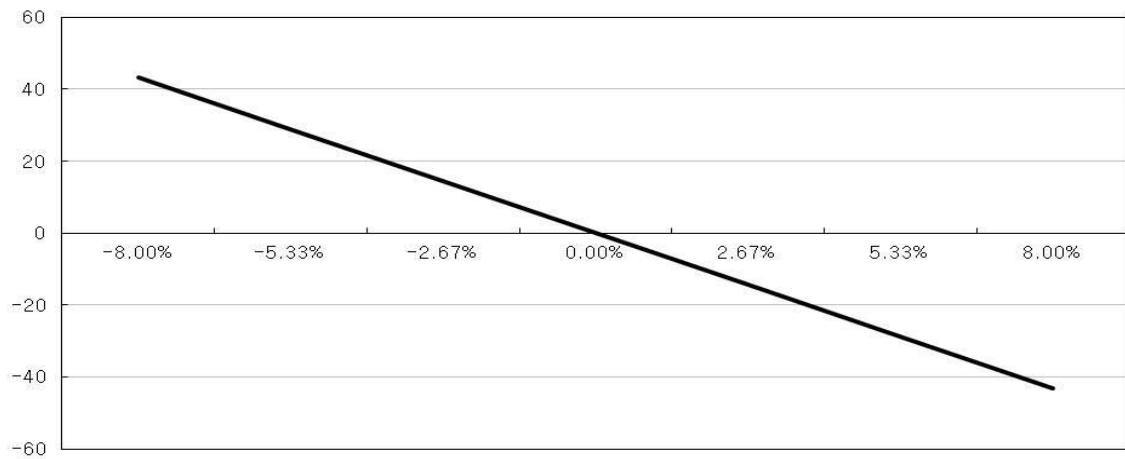
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	4,449	0	4,449	장내
신규	유가증권	선물	1,357	1,357	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,357	-1,357	장내
합계			4,449	1,357	3,092	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

399

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2021-04-08

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	1,123	0	1,123	장내
신규	유가증권	선물	716	716	0	장내
누계	유가증권	선물	0	716	-716	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4,433	4,115	319	장외
합계			5,556	4,830	726	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

215