

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-09

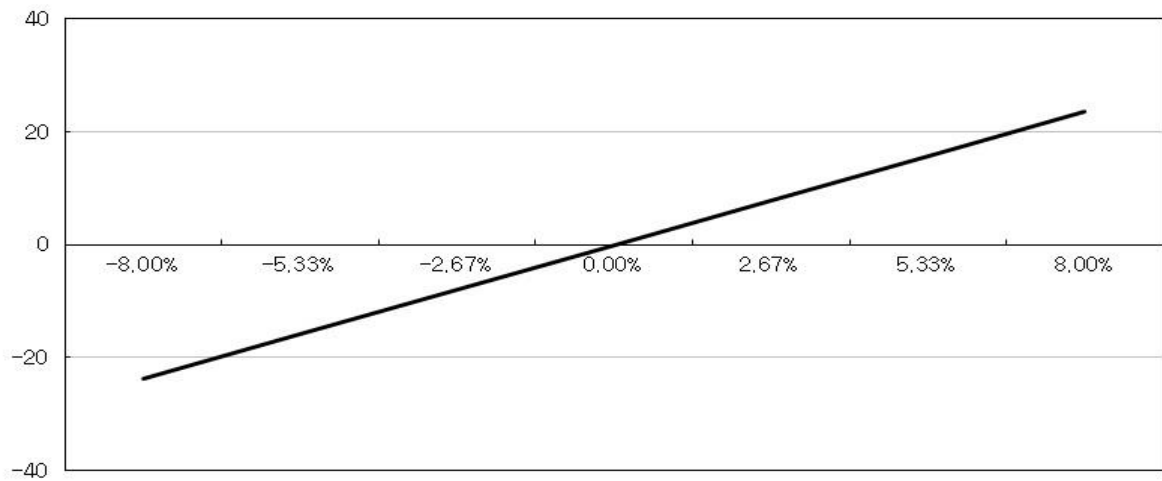
1. 계약금액

(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	5	0	5	장내
누계	주식	주식	10,985	0	10,985	장내
합계			11,305	0	11,305	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,094

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-09

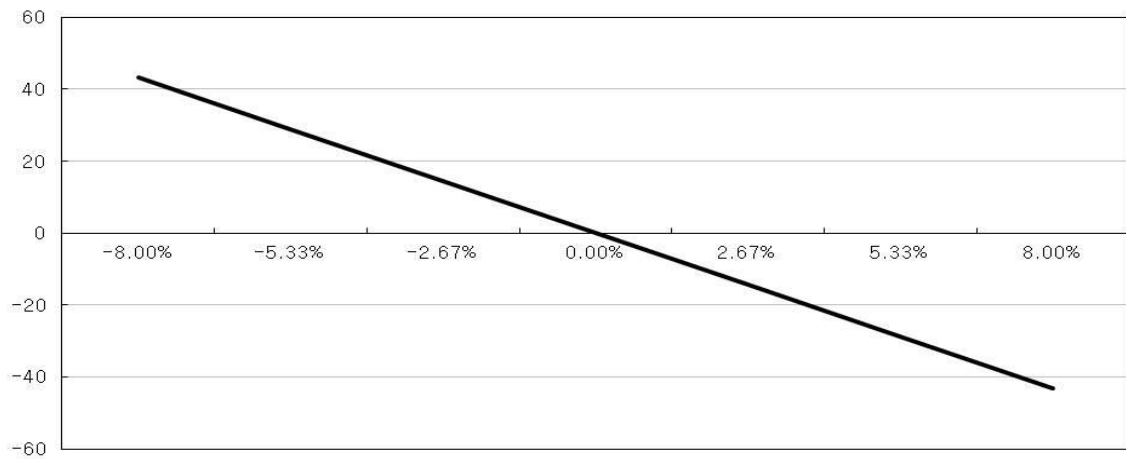
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	63	-63	장내
누계	주식	주식	4,431	0	4,431	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,353	-1,353	장내
합계			4,431	1,353	3,078	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

400

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

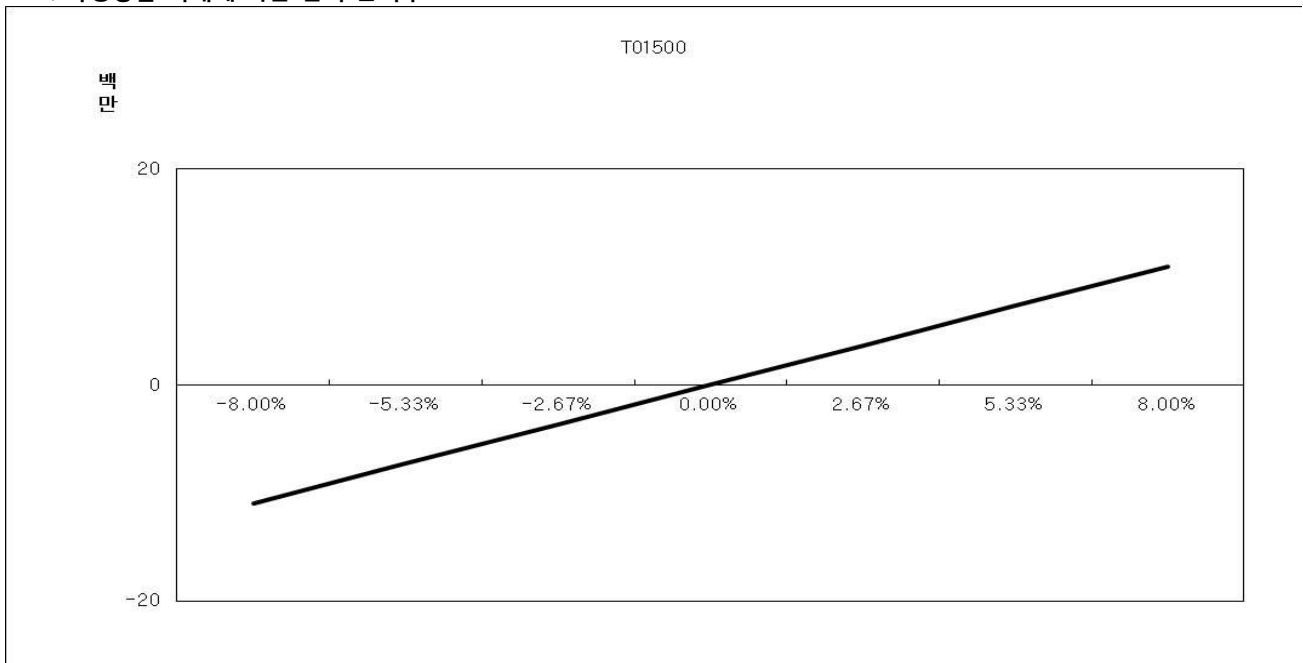
공시일: 2021-04-09

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	1,131	0	1,131	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	722	-722	장내
신규	주가지수	스왑	8,240	8,240	0	장외
누계	주가지수	스왑	4,439	4,120	319	장외
합계			5,570	4,843	727	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

214