

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-14

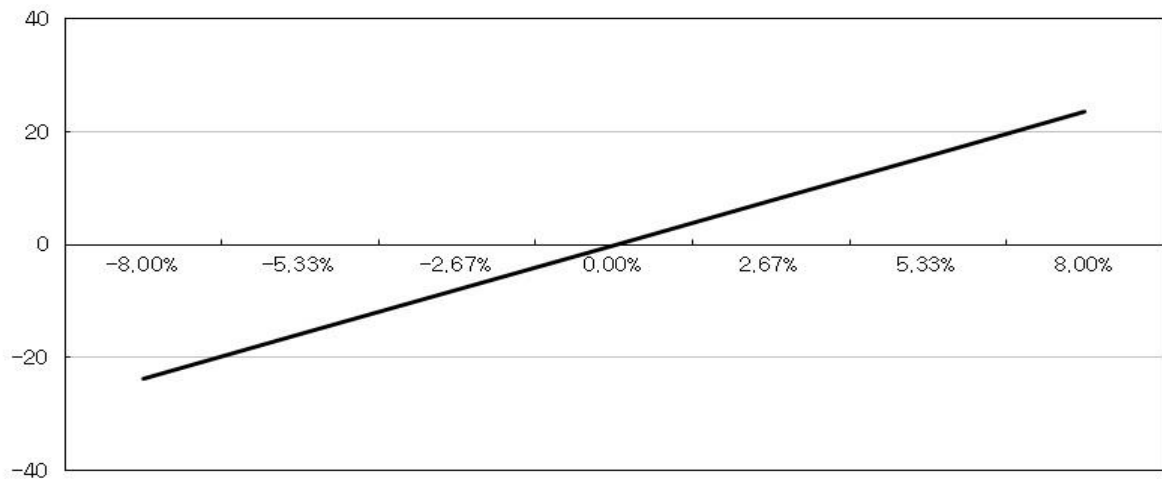
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,038	0	2,038	장내
누계	주가지수	선물	4,398	0	4,398	장내
신규	주식	주식	1,219	0	1,219	장내
누계	주식	주식	12,258	0	12,258	장내
합계			16,656	0	16,656	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

351

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,476

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-14

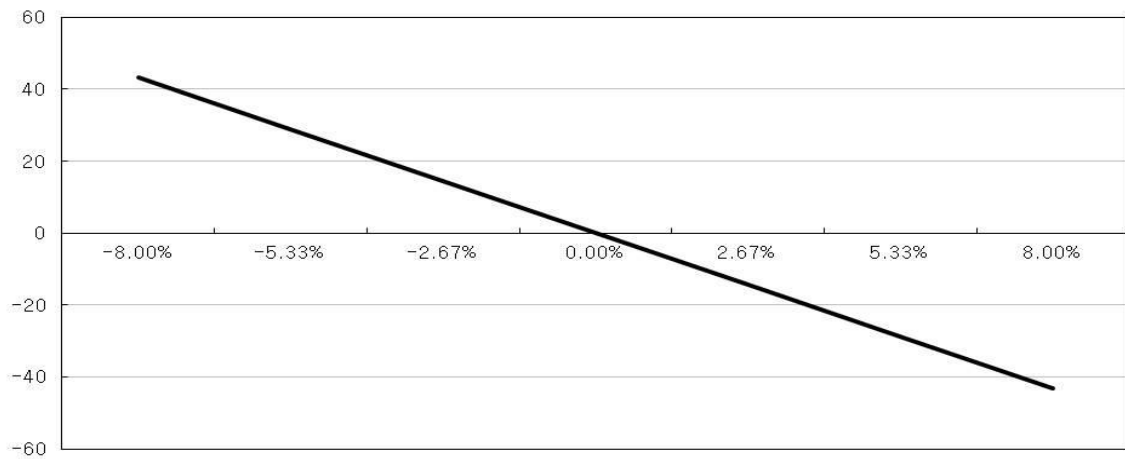
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	60	348	-287	장내
누계	주식	주식	4,198	0	4,198	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,361	-1,361	장내
합계			4,198	1,361	2,837	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

383

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

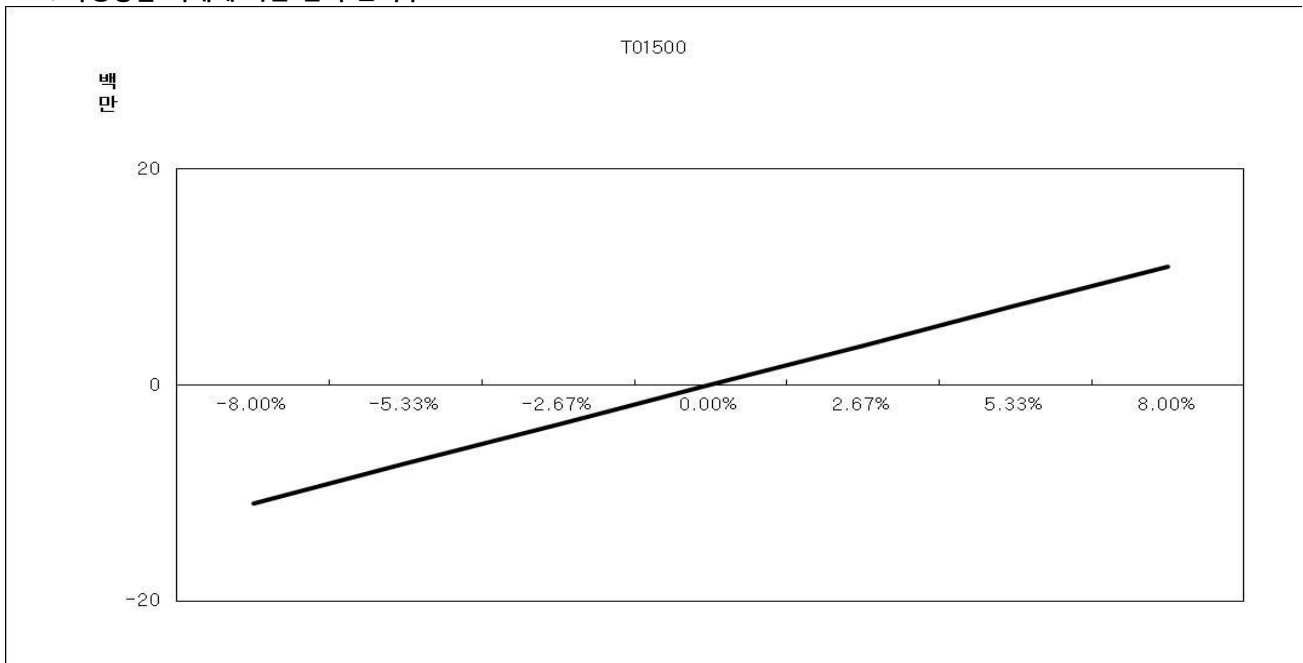
공시일: 2021-04-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	69	-69	장내
누계	주식	주식	1,067	0	1,067	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	603	-603	장내
신규	주가지수	스왑	1,101	884	217	장외
누계	주가지수	스왑	3,506	2,992	514	장외
합계			4,573	3,595	978	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

210