

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-15

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	4,415	0	4,415	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	12,301	0	12,301	장내
합계			16,716	0	16,716	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

353

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,480

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-15

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	4,200	0	4,200	장내
신규	유가증권	선물	0	37	-37	장내
누계	유가증권	선물	0	1,403	-1,403	장내
합계			4,200	1,403	2,797	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

376

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2021-04-15

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	1,071	0	1,071	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	604	-604	장내
신규	주가지수	스왑	0	90	-90	장외
누계	주가지수	스왑	3,406	2,987	419	장외
합계			4,477	3,591	886	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

206