

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-08

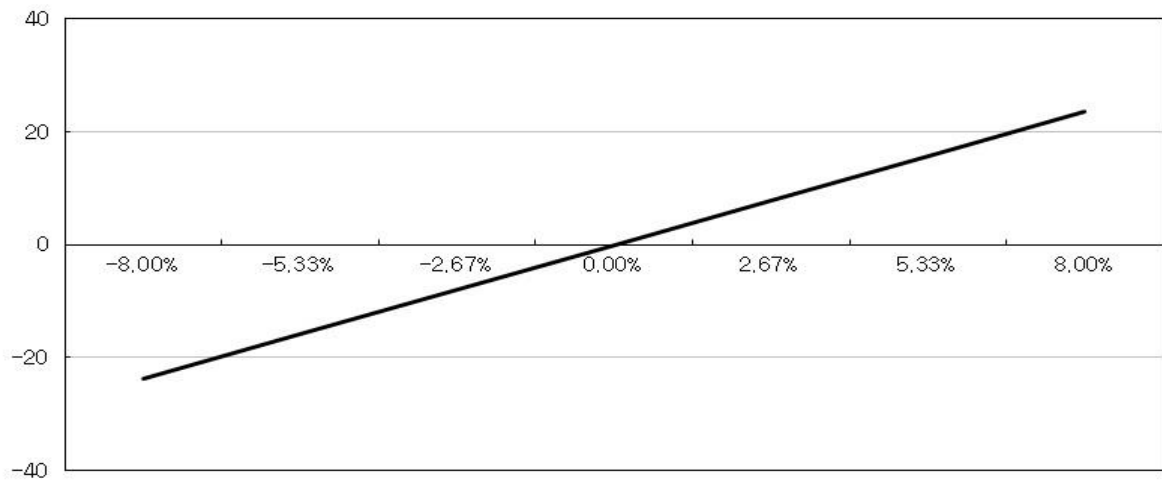
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	514	0	514	장내
신규	주식	주식	0	21	-21	장내
누계	주식	주식	10,534	0	10,534	장내
합계			11,047	0	11,047	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

41

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,546

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-08

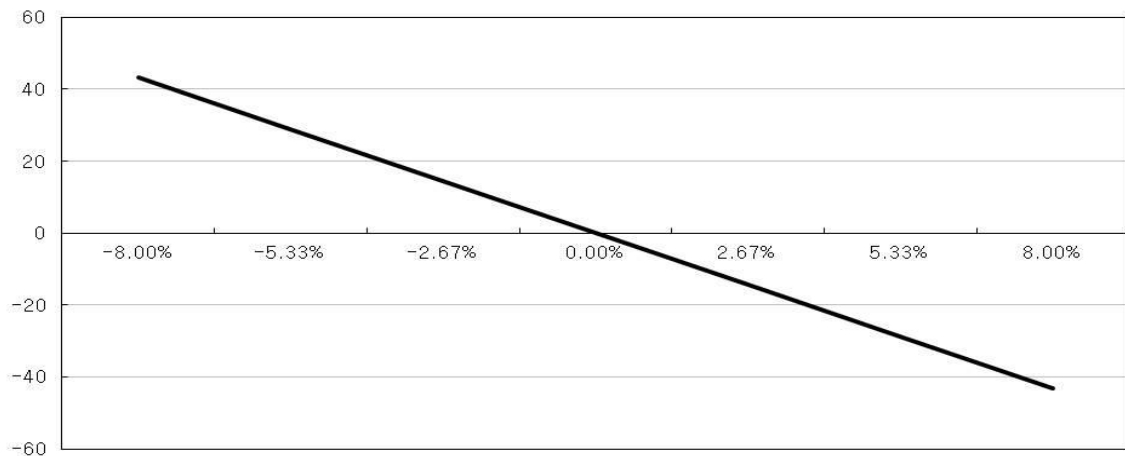
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	354	229	124	장내
누계	주식	주식	4,164	0	4,164	장내
신규	유가증권	선물	23	0	23	장내
누계	유가증권	선물	0	1,376	-1,376	장내
합계			4,164	1,376	2,787	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

373

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

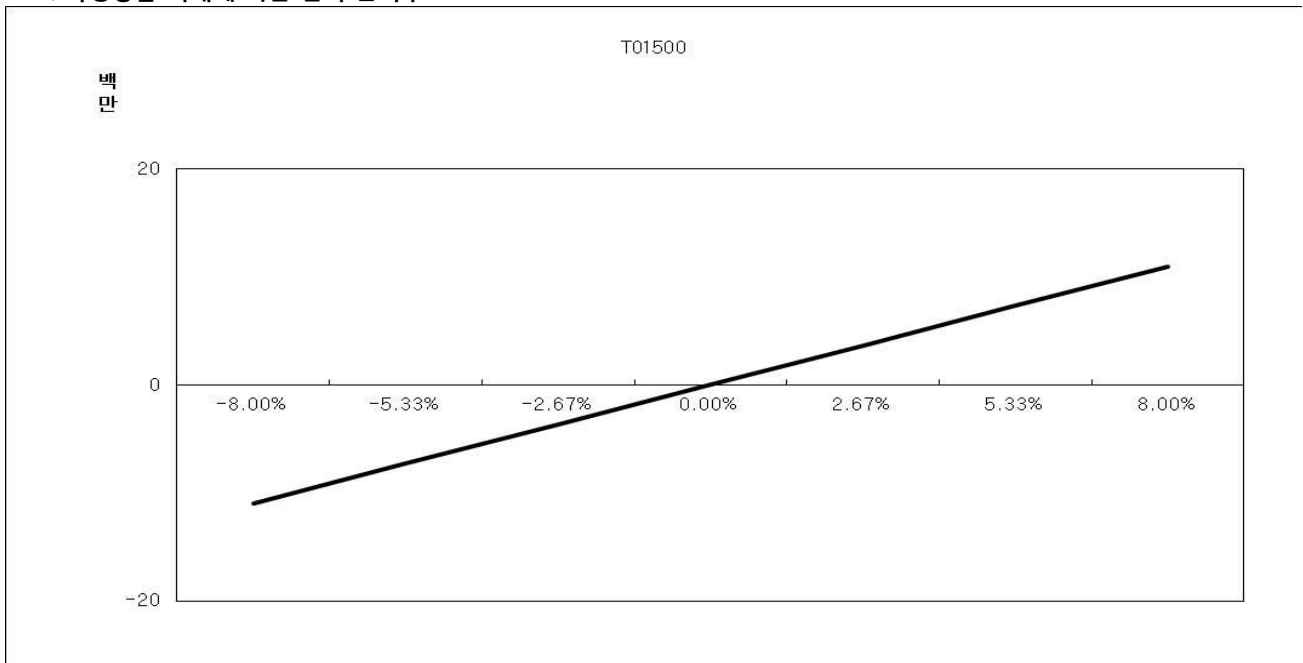
공시일: 2021-01-08

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	688	0	688	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	60	-60	장내
신규	주가지수	스왑	93	39	55	장외
누계	주가지수	스왑	71,969	4,305	67,664	장외
합계			72,658	4,365	68,292	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,896