

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-13

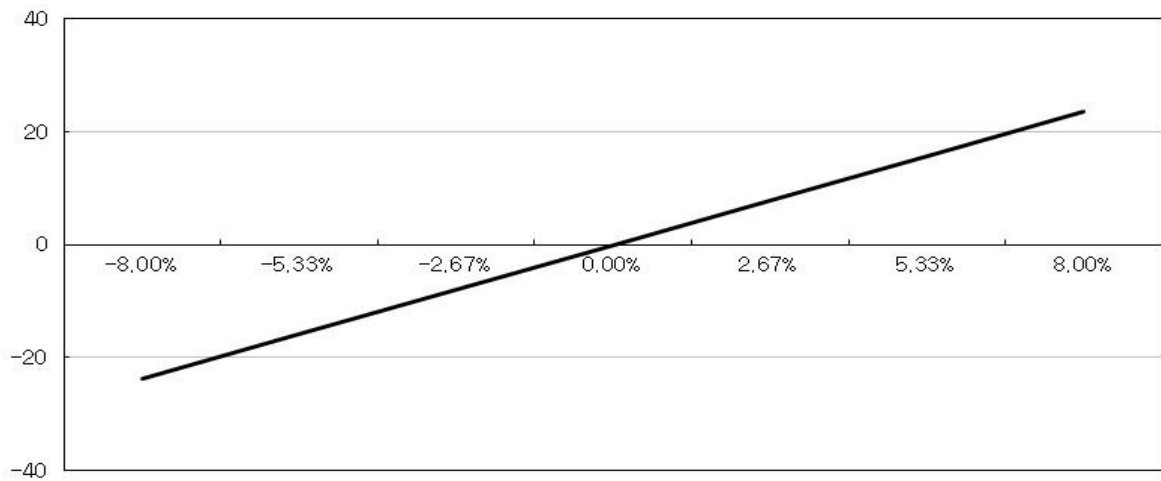
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	428	0	428	장내
신규	주식	주식	3	3	1	장내
누계	주식	주식	10,997	0	10,997	장내
합계			11,425	0	11,425	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,608

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

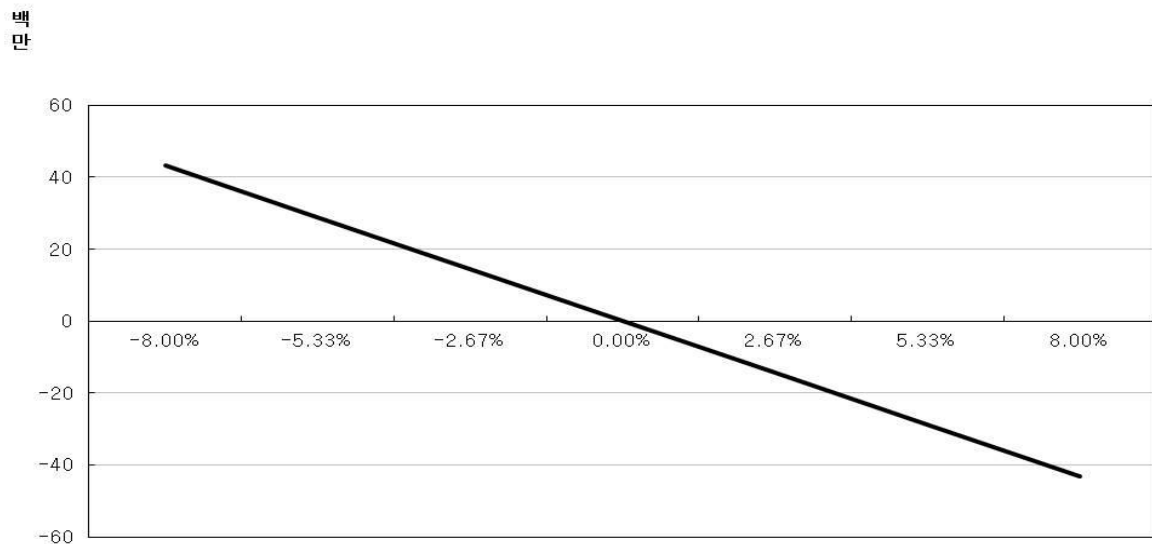
공시일: 2021-01-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	108	90	18	장내
누계	주식	주식	3,908	0	3,908	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,184	-1,184	장내
합계			3,908	1,184	2,724	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

354

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2021-01-13

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	699	0	699	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	59	-59	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	72,843	4,354	68,489	장외
합계			73,542	4,413	69,129	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,919