

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-15

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	430	0	430	장내
신규	주식	주식	3	3	0	장내
누계	주식	주식	11,048	0	11,048	장내
합계			11,478	0	11,478	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,614

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	90	91	-1	장내
누계	주식	주식	4,028	0	4,028	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,192	-1,192	장내
합계			4,028	1,192	2,836	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

364

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2021-01-15

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	702	0	702	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	60	-60	장내
신규	주가지수	스왑	113	50	64	장외
누계	주가지수	스왑	72,779	4,314	68,465	장외
합계			73,481	4,374	69,108	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,913