

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-02

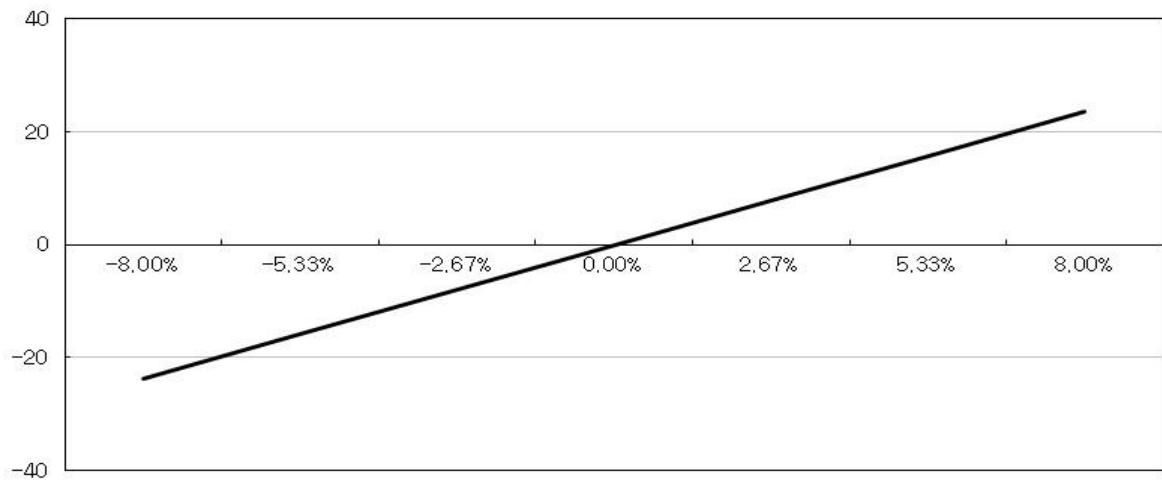
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	415	0	415	장내
신규	주식	주식	0	3	-3	장내
누계	주식	주식	10,627	0	10,627	장내
합계			11,042	0	11,042	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,572

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-02

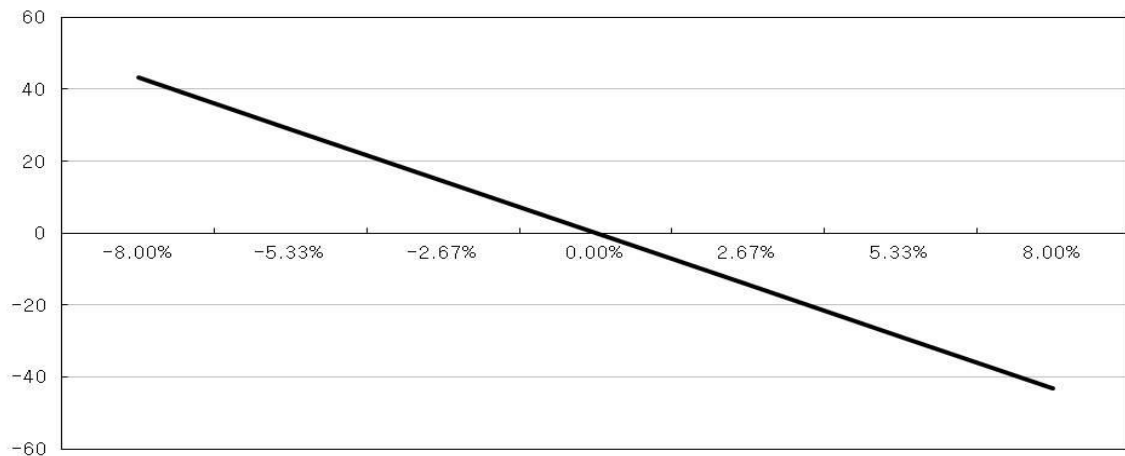
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	67	0	67	장내
누계	주식	주식	3,345	0	3,345	장내
신규	유가증권	선물	284	258	26	장내
누계	유가증권	선물	0	1,263	-1,263	장내
합계			3,345	1,263	2,082	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

304

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

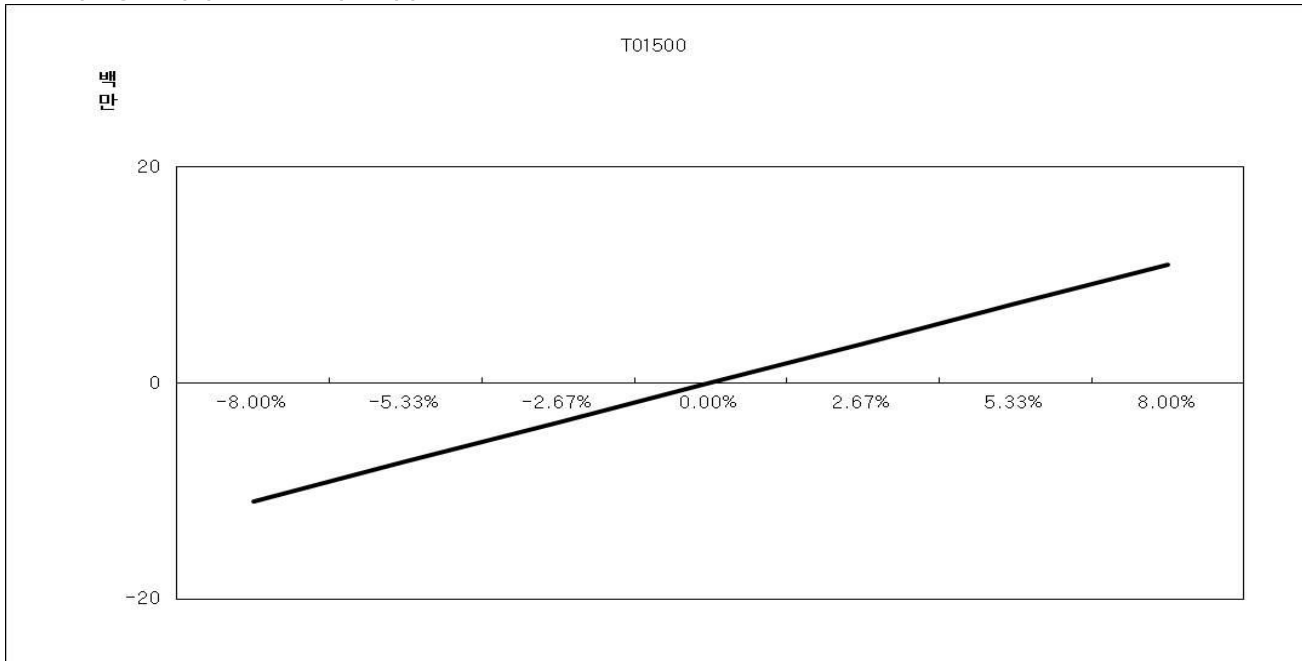
공시일: 2021-02-02

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	627	0	627	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	174	-174	장내
신규	주가지수	스왑	79	80	-1	장외
누계	주가지수	스왑	4,069	4,276	-206	장외
합계			4,696	4,450	246	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

222