

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-15

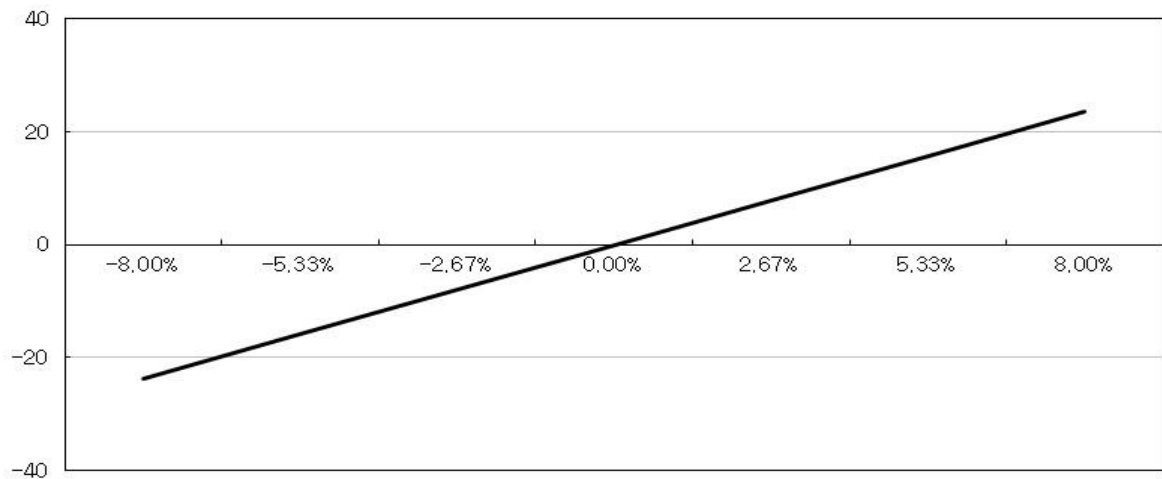
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	420	0	420	장내
신규	주식	주식	3	2	1	장내
누계	주식	주식	10,744	0	10,744	장내
합계			11,164	0	11,164	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,574

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

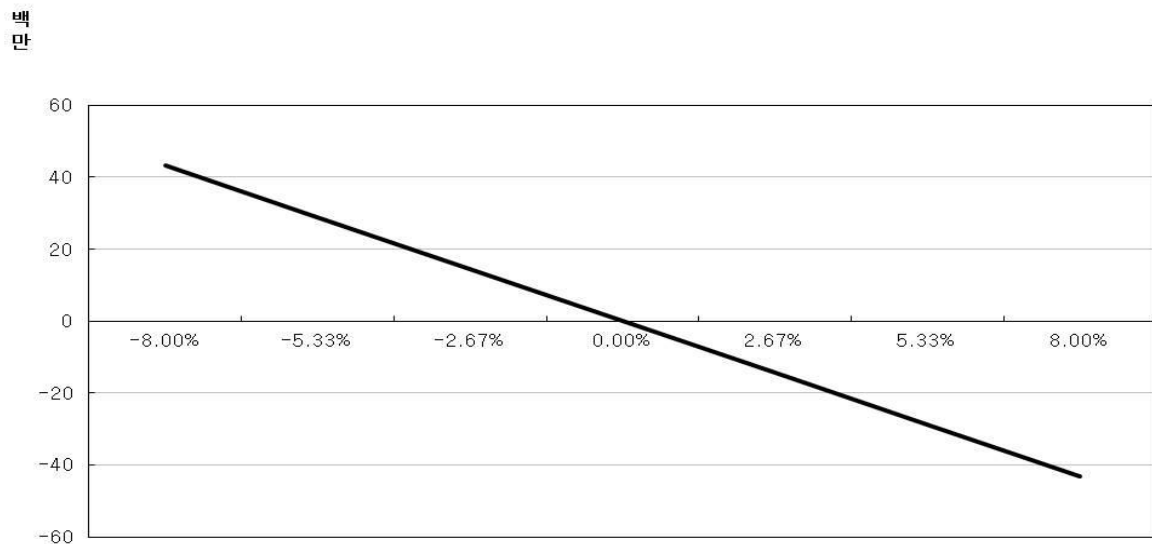
공시일: 2021-02-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	250	67	182	장내
누계	주식	주식	3,811	0	3,811	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,330	-1,330	장내
합계			3,811	1,330	2,481	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

372

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

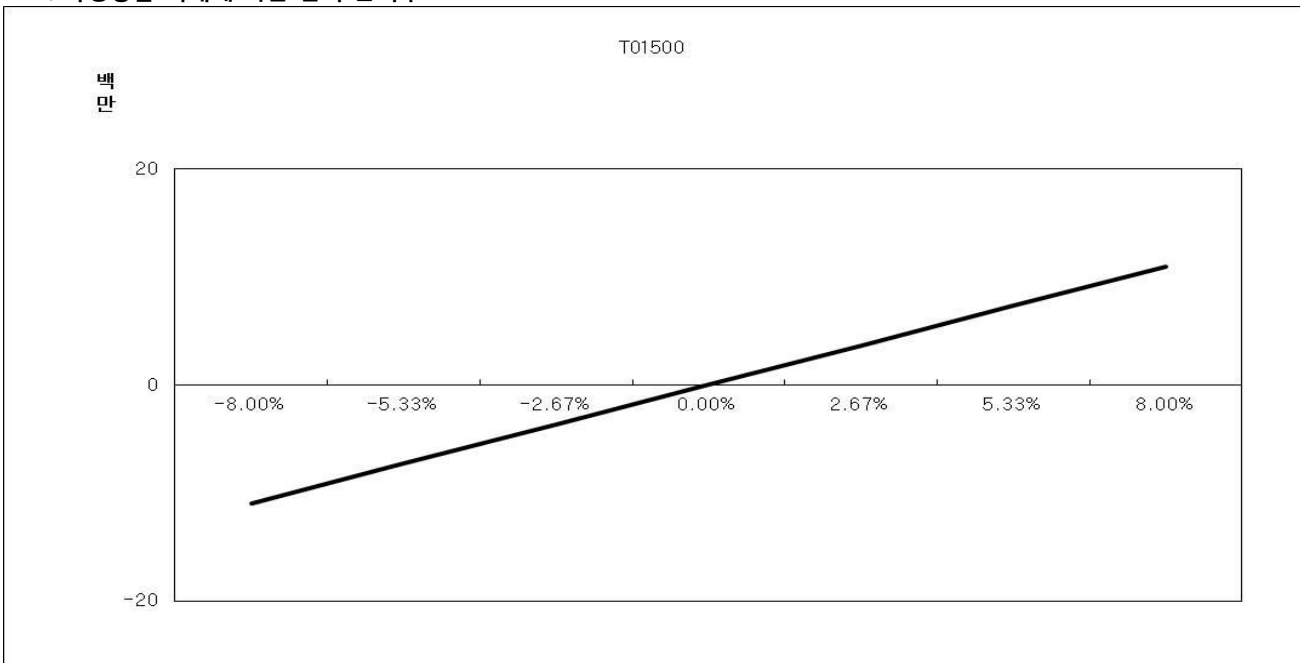
공시일: 2021-02-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	48	0	48	장내
누계	주식	주식	663	0	663	장내
신규	유가증권	선물	0	31	-31	장내
누계	유가증권	선물	0	303	-303	장내
신규	주가지수	스왑	39	0	39	장외
누계	주가지수	스왑	4,265	4,195	70	장외
합계			4,929	4,499	430	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

231