

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-24

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	416	0	416	장내
신규	주식	주식	3	6	-3	장내
누계	주식	주식	10,617	0	10,617	장내
합계			11,033	0	11,033	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,540

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	523	401	122	장내
누계	주식	주식	4,364	0	4,364	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,352	-1,352	장내
합계			4,364	1,352	3,012	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

459

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2021-02-24

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	757	0	757	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	395	-395	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4,169	4,440	-270	장외
합계			4,926	4,834	92	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

236