

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-03-30

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	309	0	309	장내
신규	주식	주식	1	0	1	장내
누계	주식	주식	10,602	0	10,602	장내
합계			10,911	0	10,911	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,117

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-03-30

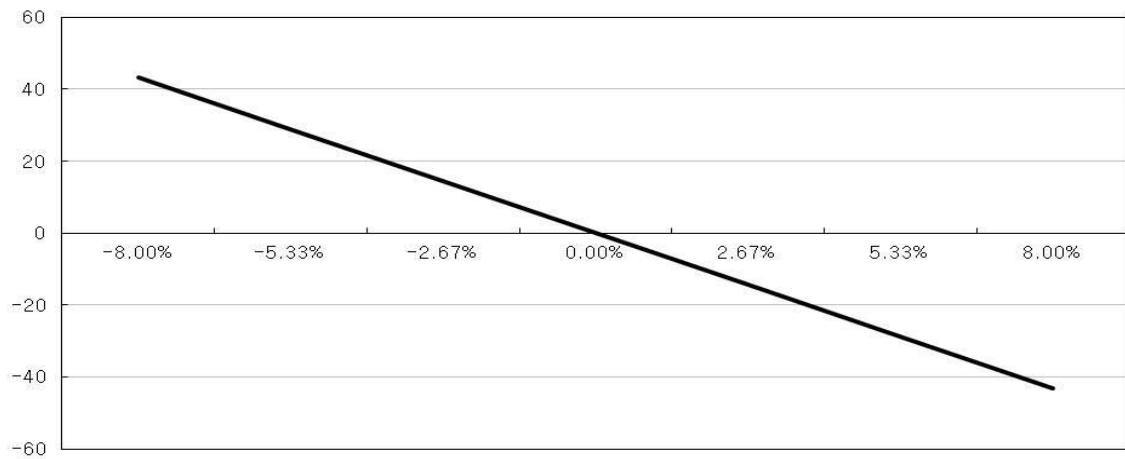
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	4,365	0	4,365	장내
신규	유가증권	선물	22	0	22	장내
누계	유가증권	선물	0	1,318	-1,318	장내
합계			4,365	1,318	3,047	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

417

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2021-03-30

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	1,098	0	1,098	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	707	-707	장내
신규	주가지수	스왑	21	53	-32	장외
누계	주가지수	스왑	3,879	4,038	-159	장외
합계			4,977	4,746	232	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

195