

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-01-14

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	6	5	1	장내
누계	주식	주식	11,062	0	11,062	장내
합계			11,492	0	11,492	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,617

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

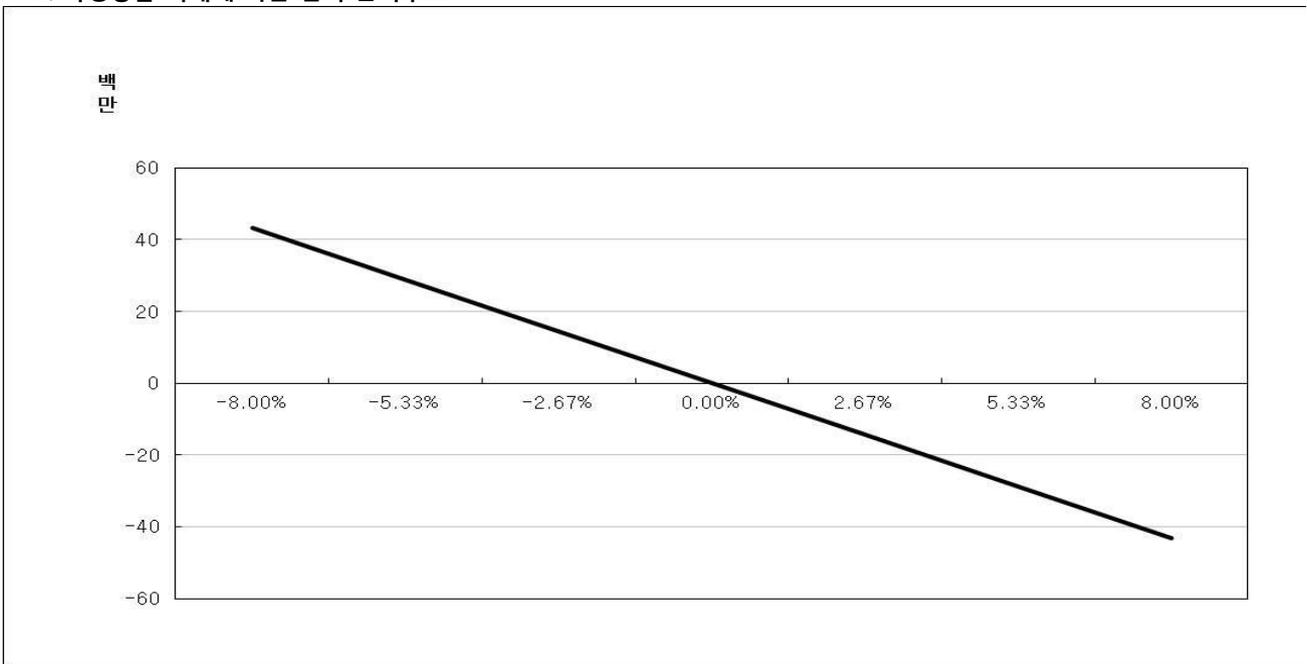
공시일: 2021-01-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	88	45	43	장내
누계	주식	주식	3,984	0	3,984	장내
신규	유가증권	선물	1,198	1,198	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,198	-1,198	장내
합계			3,984	1,198	2,786	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

357

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

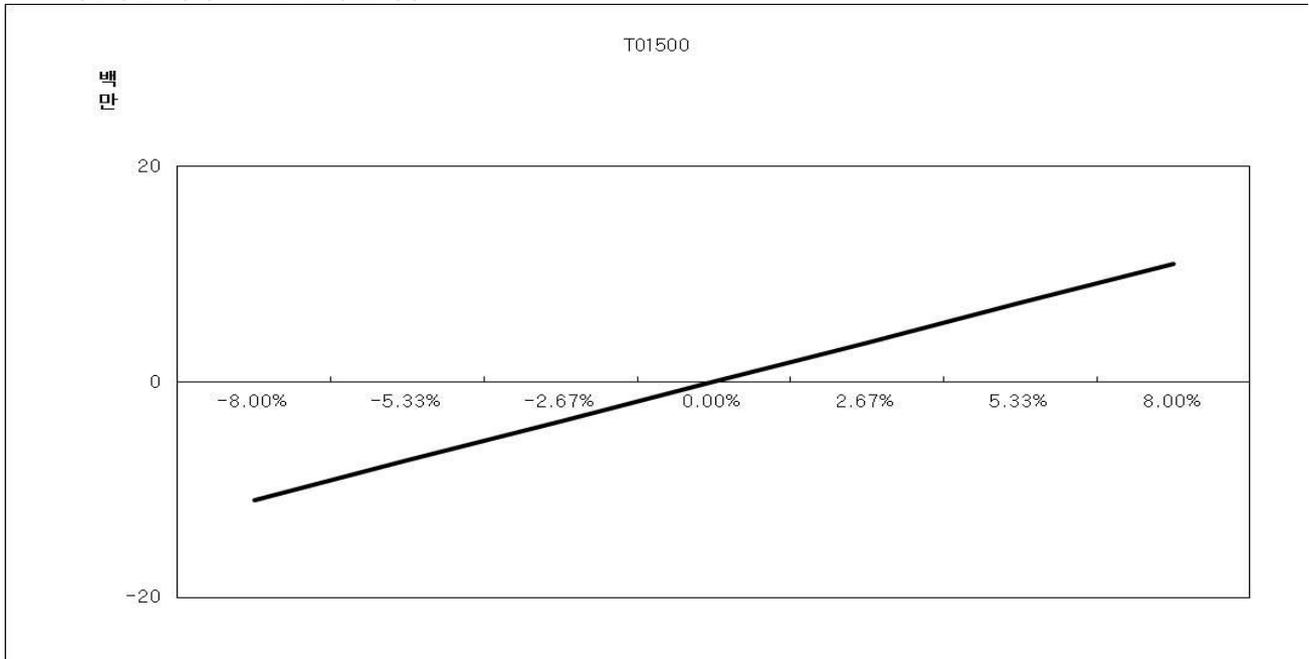
공시일: 2021-01-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	20	-20	장내
누계	주식	주식	692	0	692	장내
신규	유가증권	선물	59	59	0	장내
누계	유가증권	선물	0	59	-59	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	72,587	4,375	68,212	장외
합계			73,278	4,434	68,844	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,907