

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-01

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 | 405 | 0 | 405 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 10,352 | 0 | 10,352 | 장내 |
| 합계 | | | 10,757 | 0 | 10,757 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

32

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,523

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

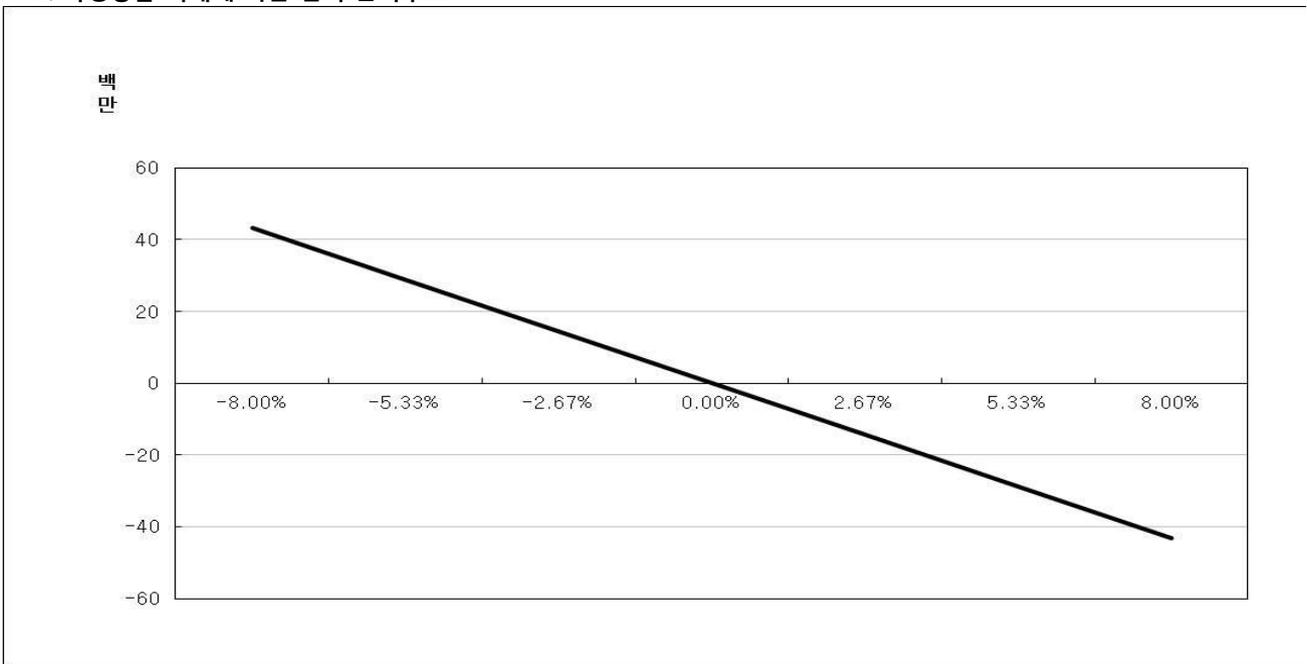
공시일: 2021-02-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 107 | 118 | -11 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 3,224 | 0 | 3,224 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 273 | 155 | 119 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 1,239 | -1,239 | 장내 |
| 합계 | | | 3,224 | 1,239 | 1,985 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

297

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

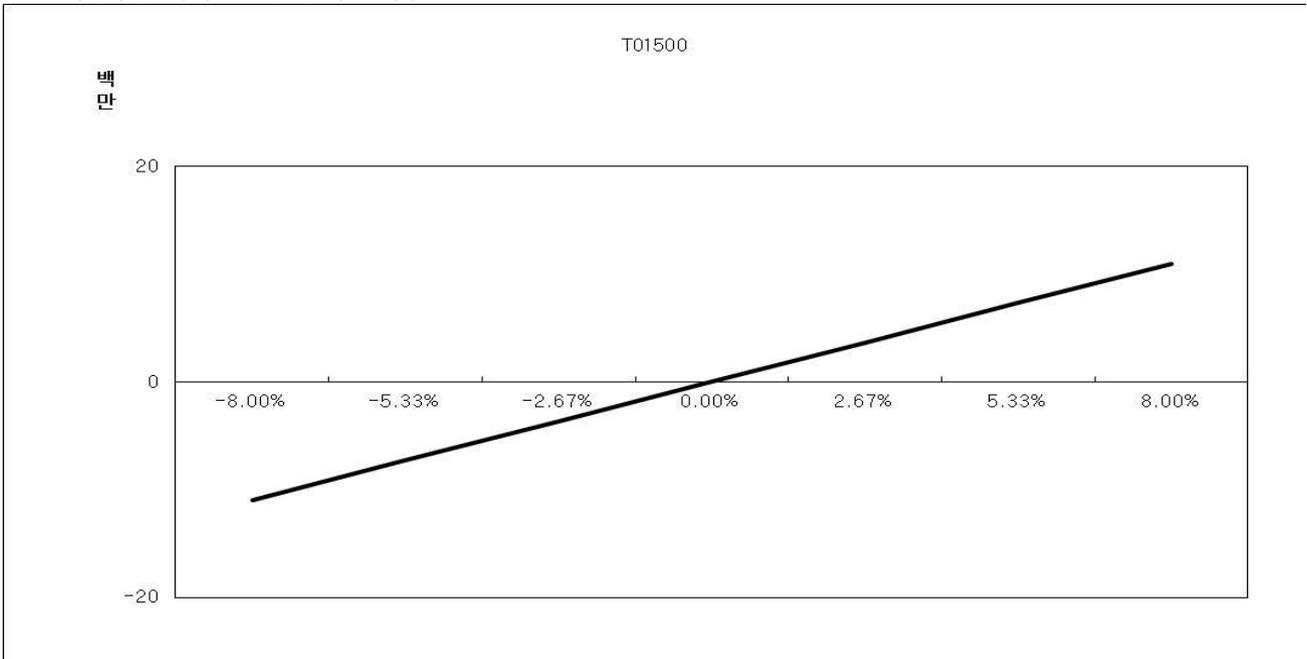
공시일: 2021-02-01

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 | 617 | 0 | 617 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 29 | 0 | 29 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 174 | -174 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 4,109 | 4,283 | -174 | 장외 |
| 합계 | | | 4,726 | 4,457 | 269 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

216