

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-04

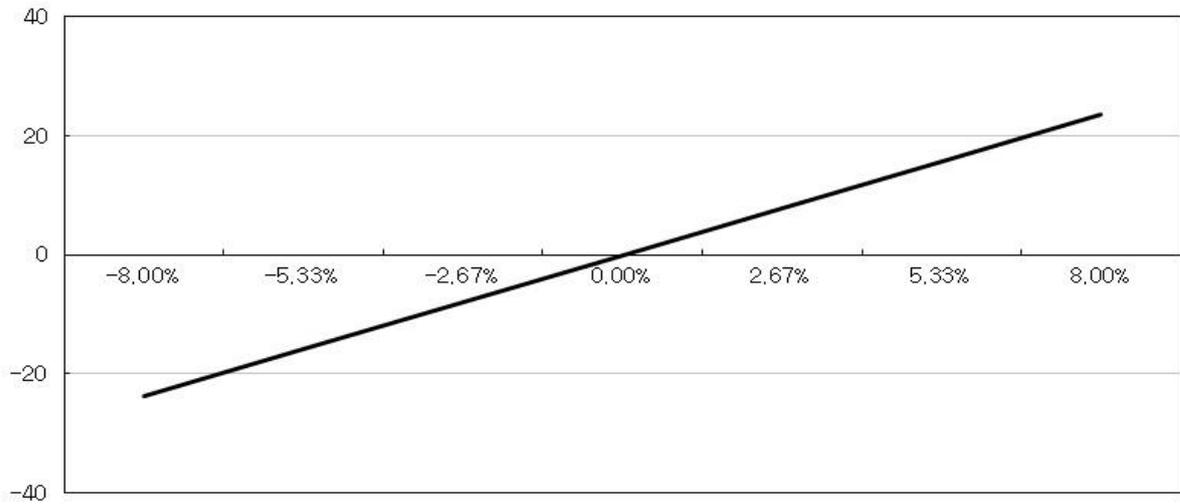
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	425	0	425	장내
신규	주식	주식	14	0	14	장내
누계	주식	주식	10,891	0	10,891	장내
합계			11,316	0	11,316	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,604

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

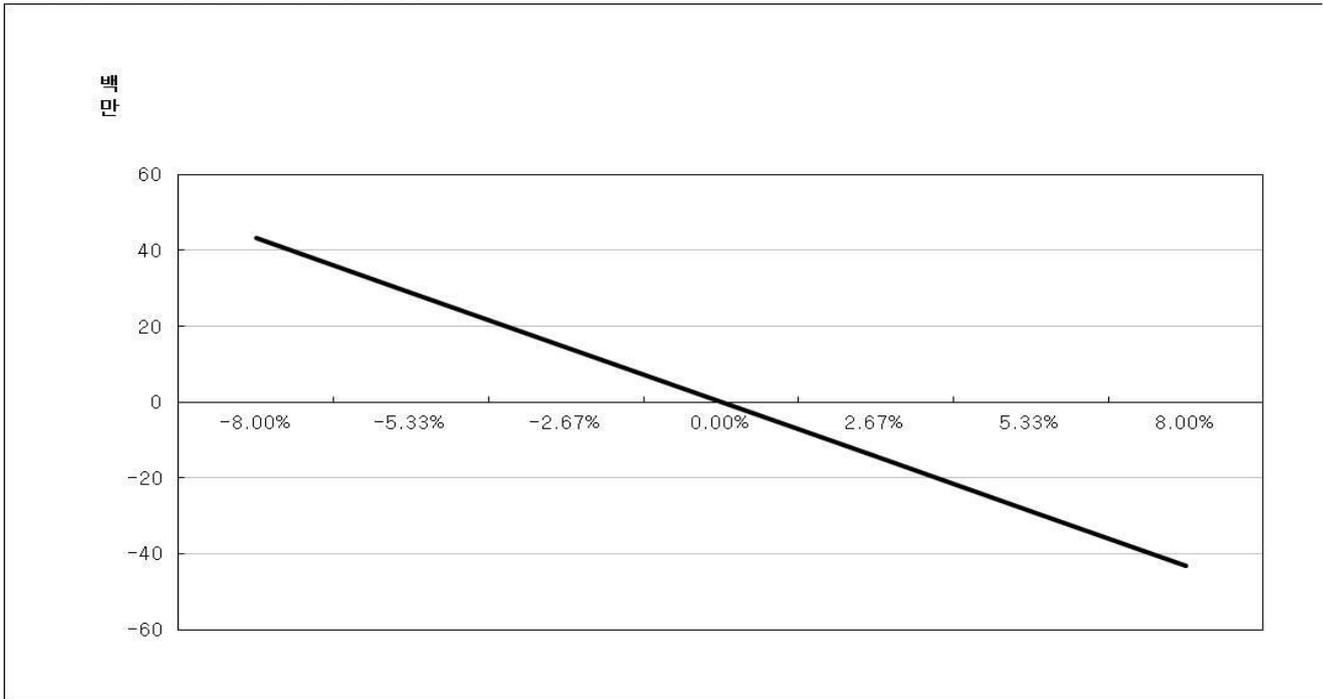
공시일: 2021-02-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	42	20	22	장내
누계	주식	주식	3,474	0	3,474	장내
신규	유가증권	선물	95	125	-30	장내
누계	유가증권	선물	0	1,330	-1,330	장내
합계			3,474	1,330	2,145	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

319

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

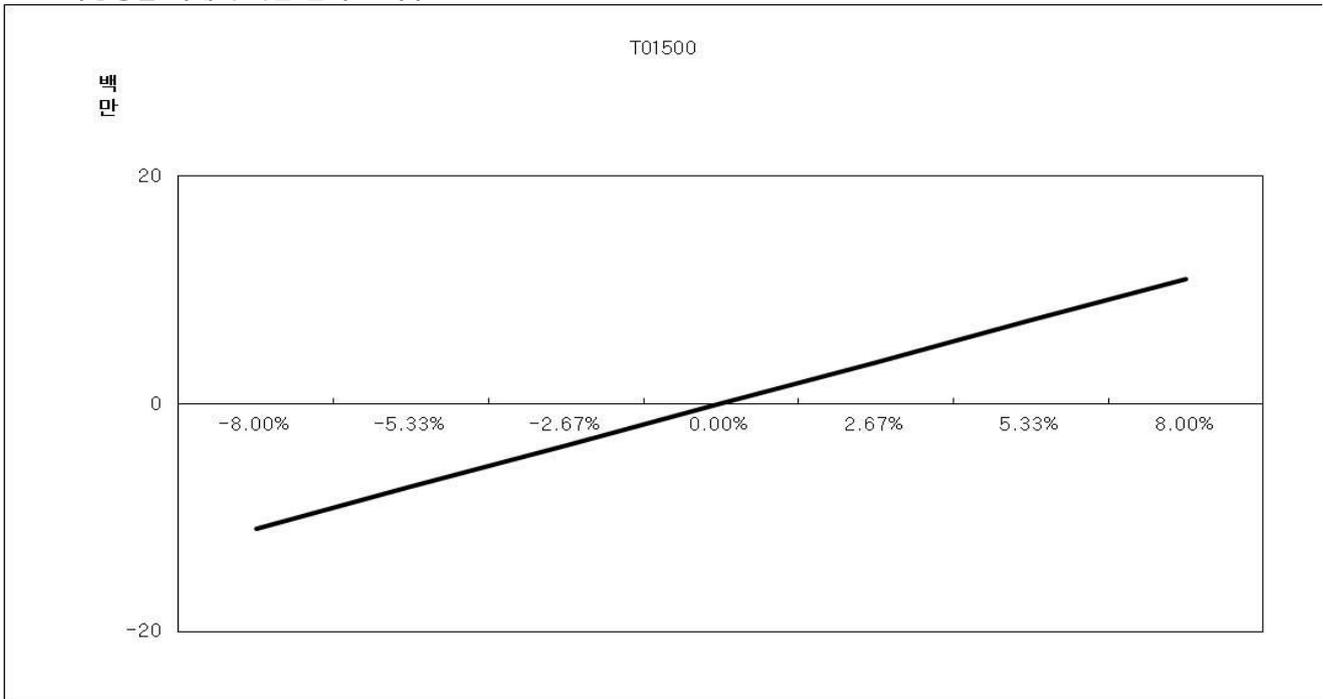
공시일: 2021-02-04

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	636	0	636	장내
신규	유가증권	선물	0	137	-137	장내
누계	유가증권	선물	0	317	-317	장내
신규	주가지수	스왑	149	34	115	장외
누계	주가지수	스왑	4,027	4,060	-33	장외
합계			4,663	4,376	287	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

216