

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-08

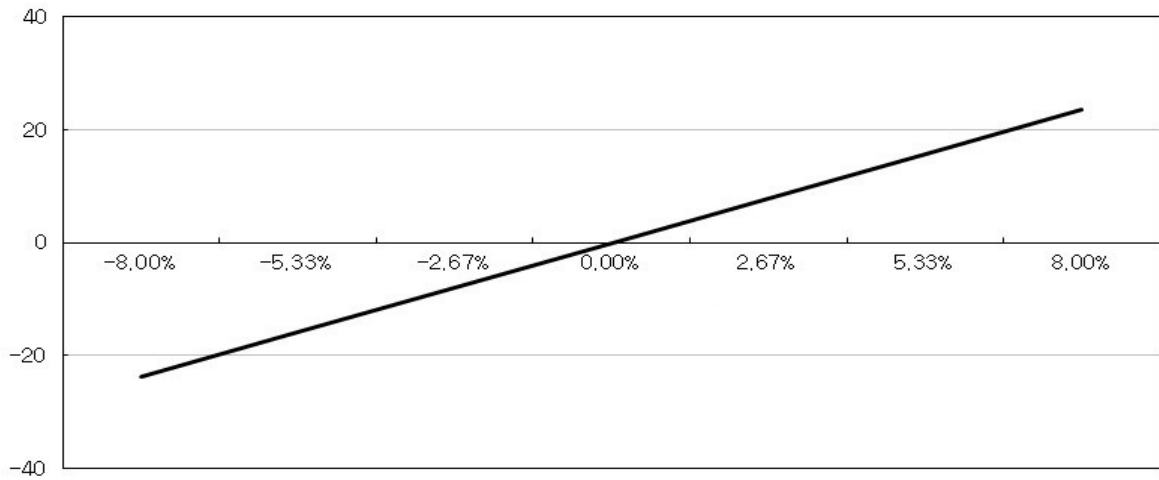
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	423	0	423	장내
신규	주식	주식	4	0	4	장내
누계	주식	주식	10,845	0	10,845	장내
합계			11,268	0	11,268	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1,593

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-08

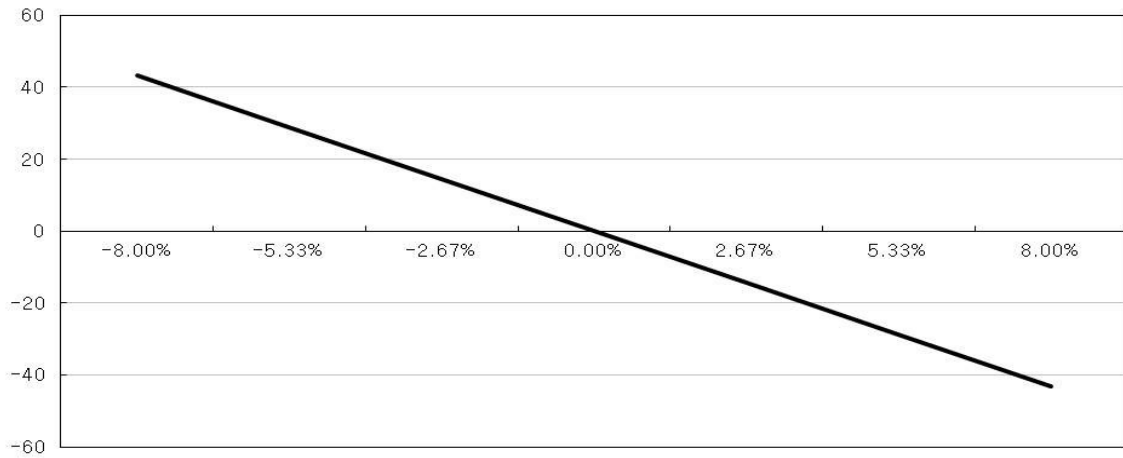
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	137	145	-8	장내
누계	주식	주식	3,381	0	3,381	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,321	-1,321	장내
합계			3,381	1,321	2,060	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

306

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

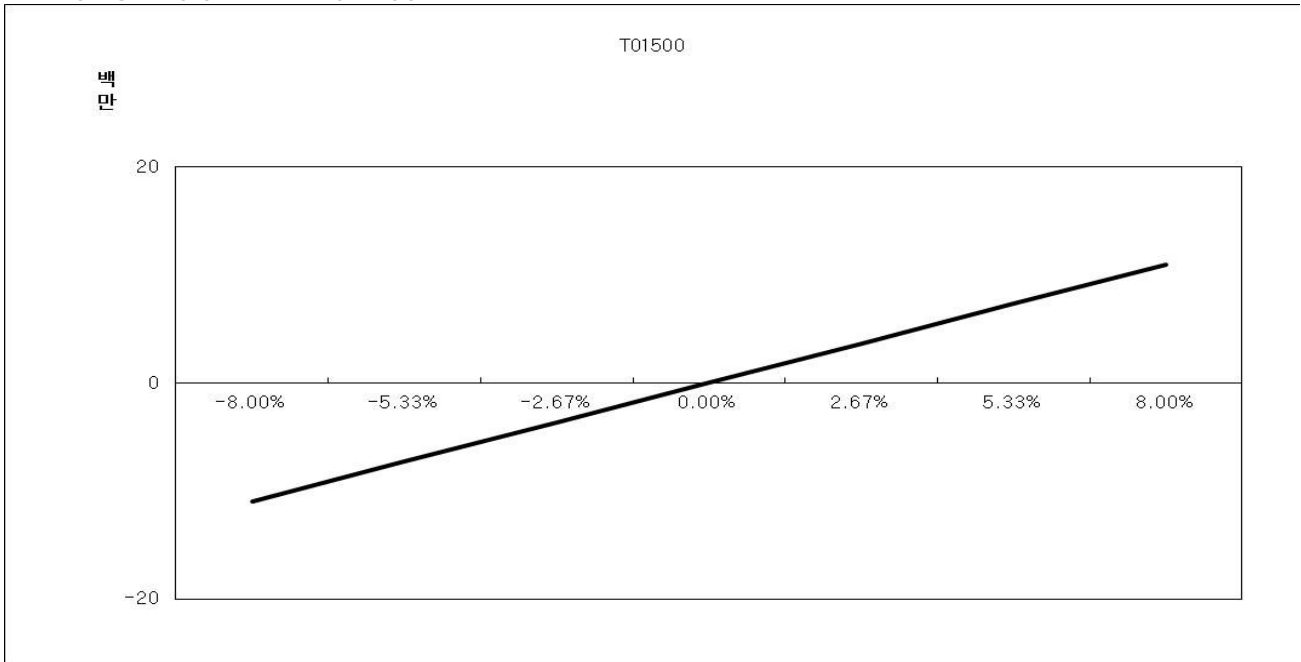
공시일: 2021-02-08

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	45	-45	장내
누계	주식	주식	588	0	588	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	310	-310	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4,077	4,109	-32	장외
합계			4,665	4,419	247	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

219