

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-18

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	424	0	424	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,865	0	10,865	장내
합계			11,289	0	11,289	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,593

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-18

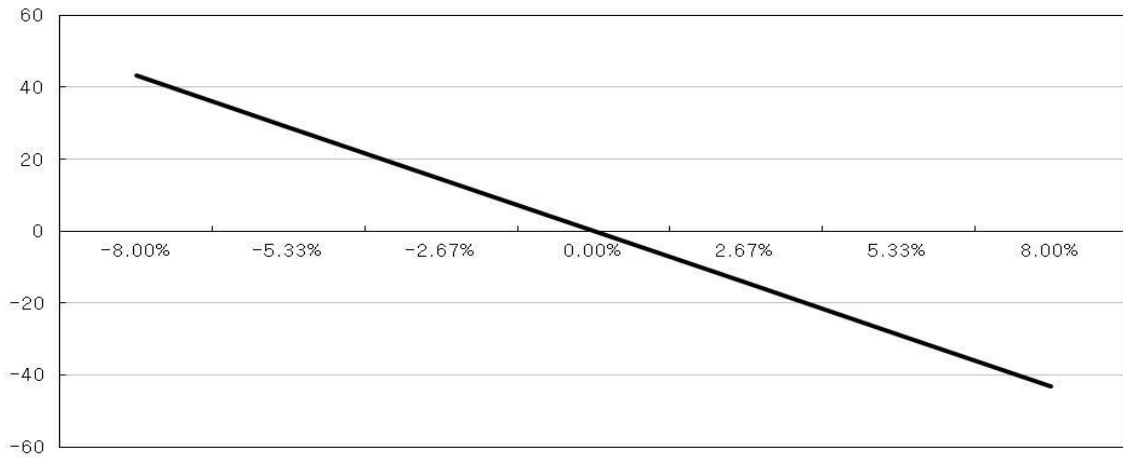
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	281	49	232	장내
누계	주식	주식	4,285	0	4,285	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,315	-1,315	장내
합계			4,285	1,315	2,970	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

424

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

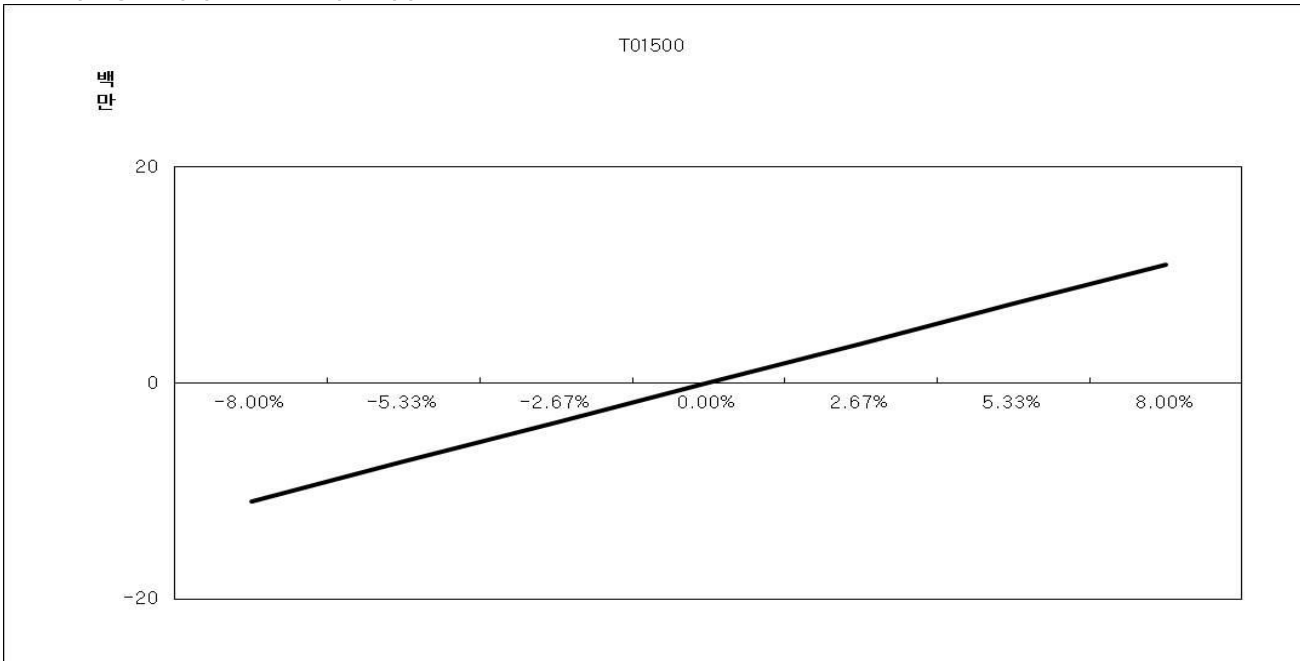
공시일: 2021-02-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	54	27	27	장내
누계	주식	주식	730	0	730	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	381	-381	장내
신규	주가지수	스왑	132	72	59	장외
누계	주가지수	스왑	4,385	4,293	91	장외
합계			5,114	4,674	440	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

236