

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-22

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	421	0	421	장내
신규	주식	주식	0	16	-16	장내
누계	주식	주식	10,765	0	10,765	장내
합계			11,186	0	11,186	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,579

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

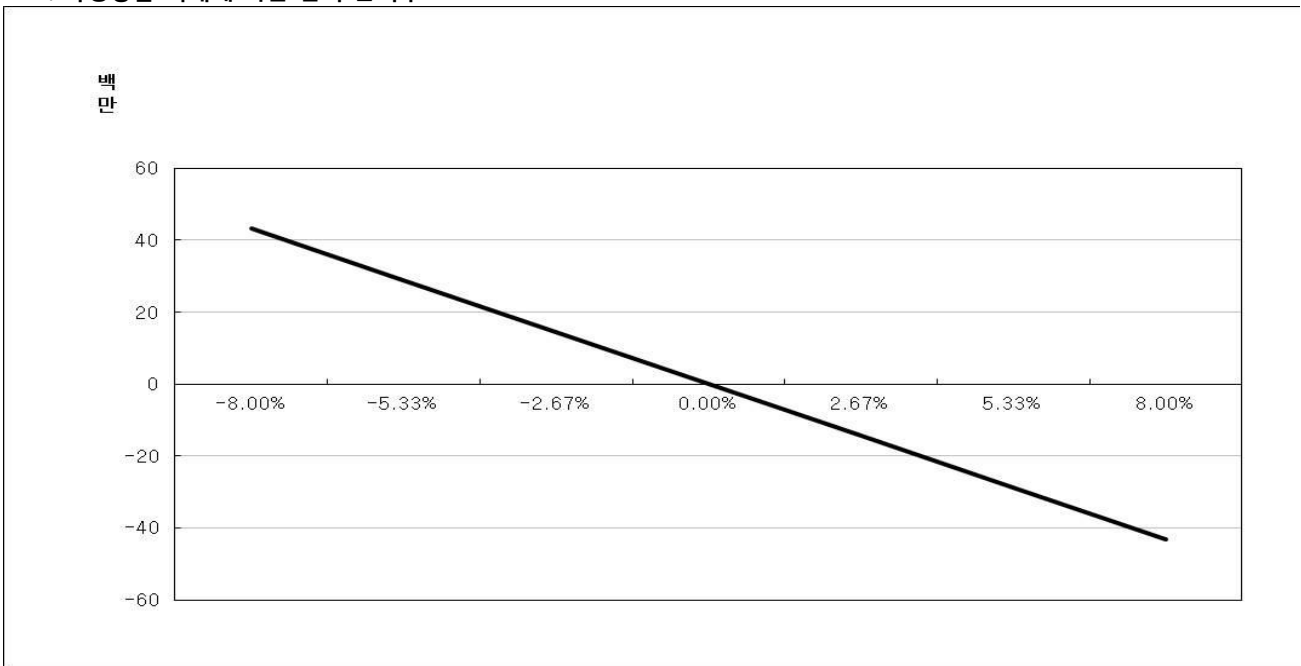
공시일: 2021-02-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	117	406	-289	장내
누계	주식	주식	4,111	0	4,111	장내
신규	유가증권	선물	170	170	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,351	-1,351	장내
합계			4,111	1,351	2,760	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

404

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

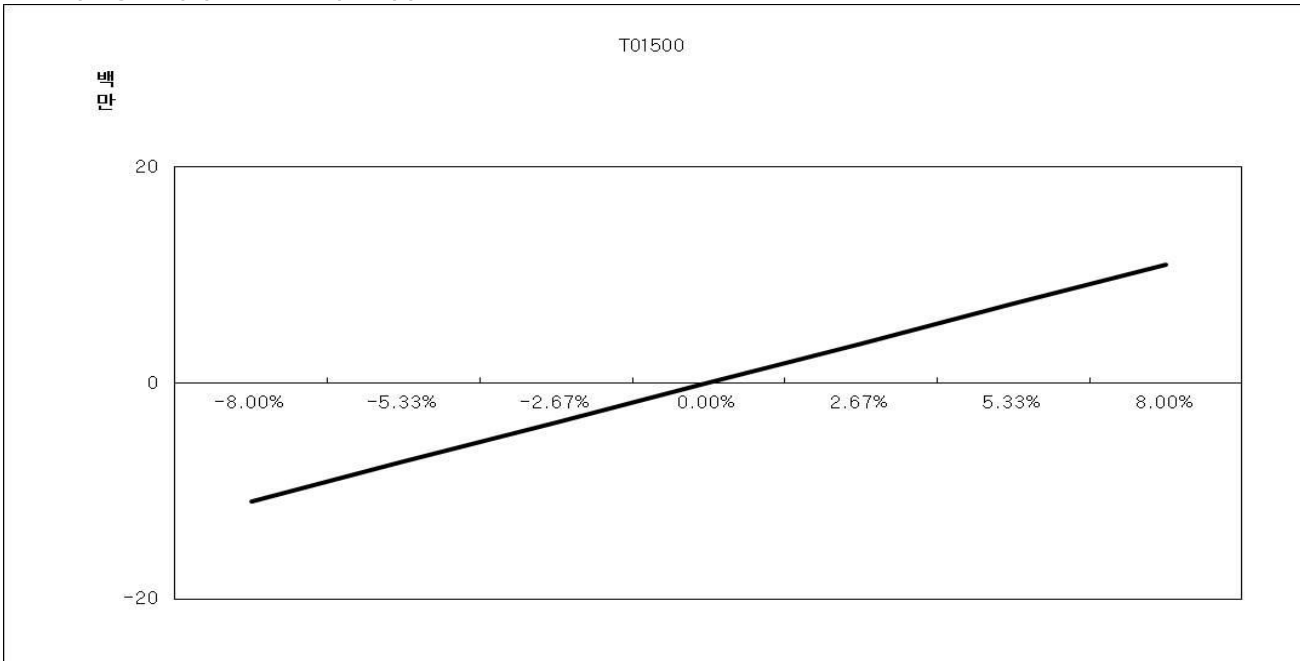
공시일: 2021-02-22

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	725	0	725	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	397	-397	장내
신규	주가지수	스왑	0	118	-118	장외
누계	주가지수	스왑	4,219	4,252	-33	장외
합계			4,944	4,649	295	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

231