

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-23

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	417	0	417	장내
신규	주식	주식	1	16	-15	장내
누계	주식	주식	10,647	0	10,647	장내
합계			11,064	0	11,064	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,550

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

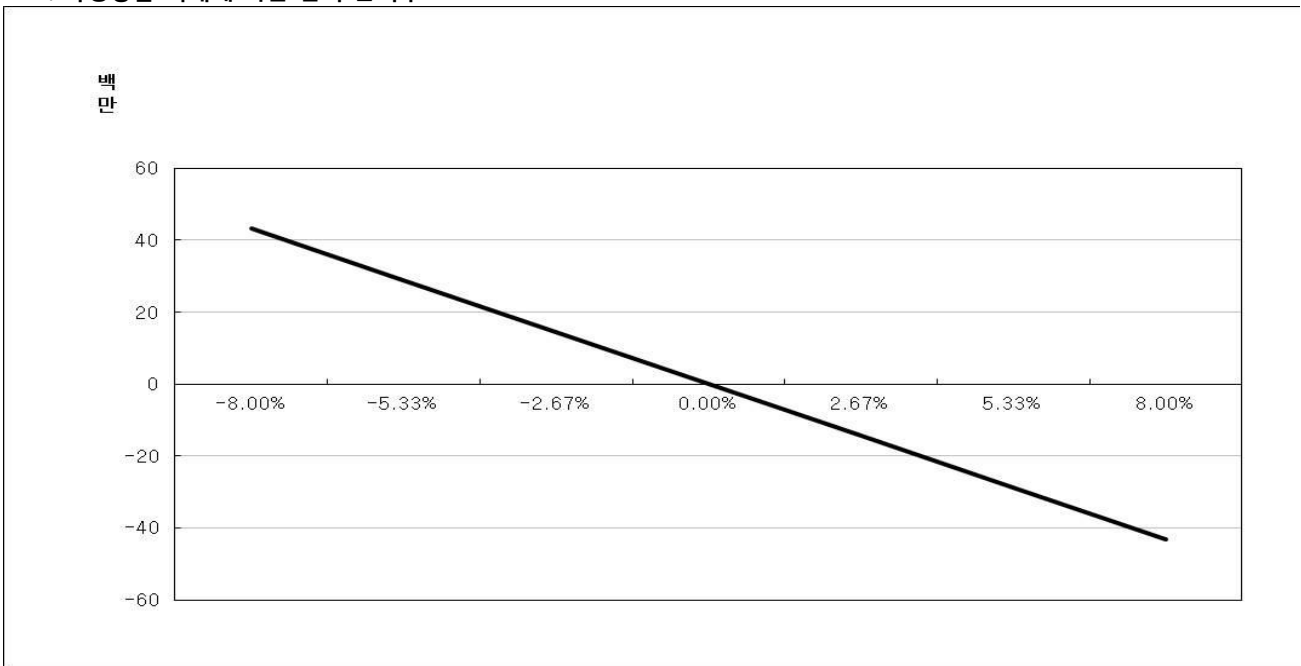
공시일: 2021-02-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	142	0	142	장내
누계	주식	주식	4,251	0	4,251	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,342	-1,342	장내
합계			4,251	1,342	2,909	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

422

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

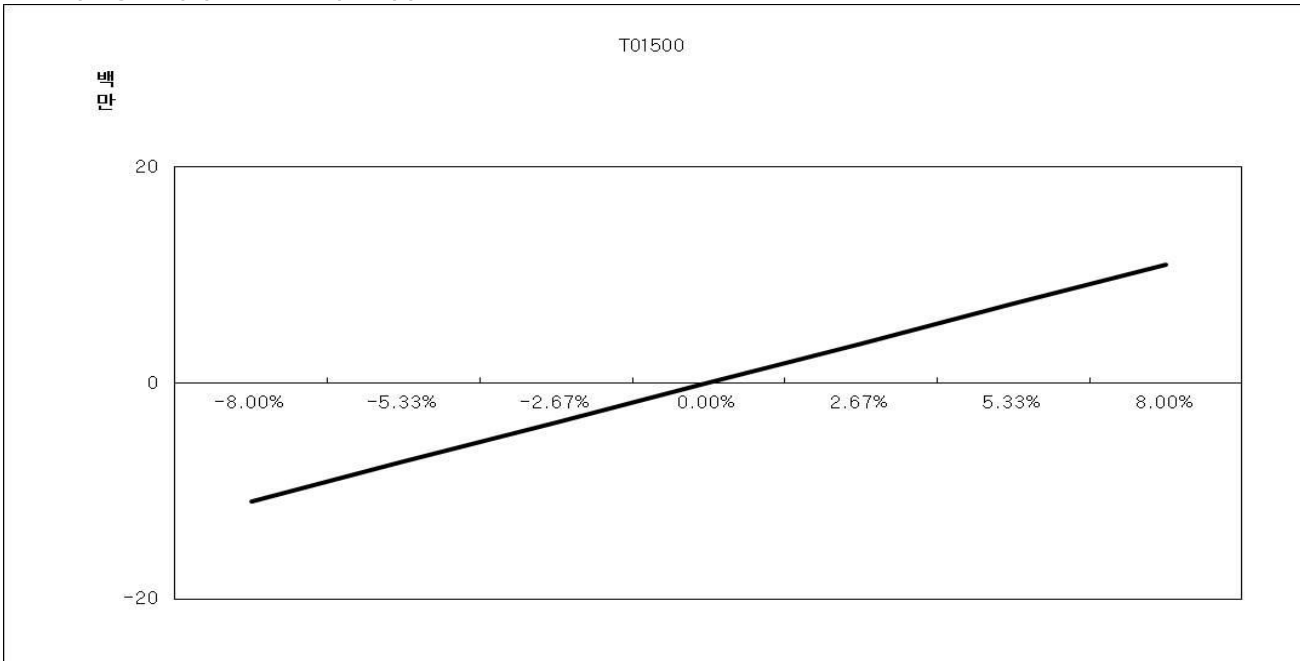
공시일: 2021-02-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	50	0	50	장내
누계	주식	주식	764	0	764	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	395	-395	장내
신규	주가지수	스왑	0	228	-228	장외
누계	주가지수	스왑	4,147	4,426	-279	장외
합계			4,911	4,820	91	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

233