

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-02-25

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	407	0	407	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,399	0	10,399	장내
합계			10,806	0	10,806	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

33

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,512

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

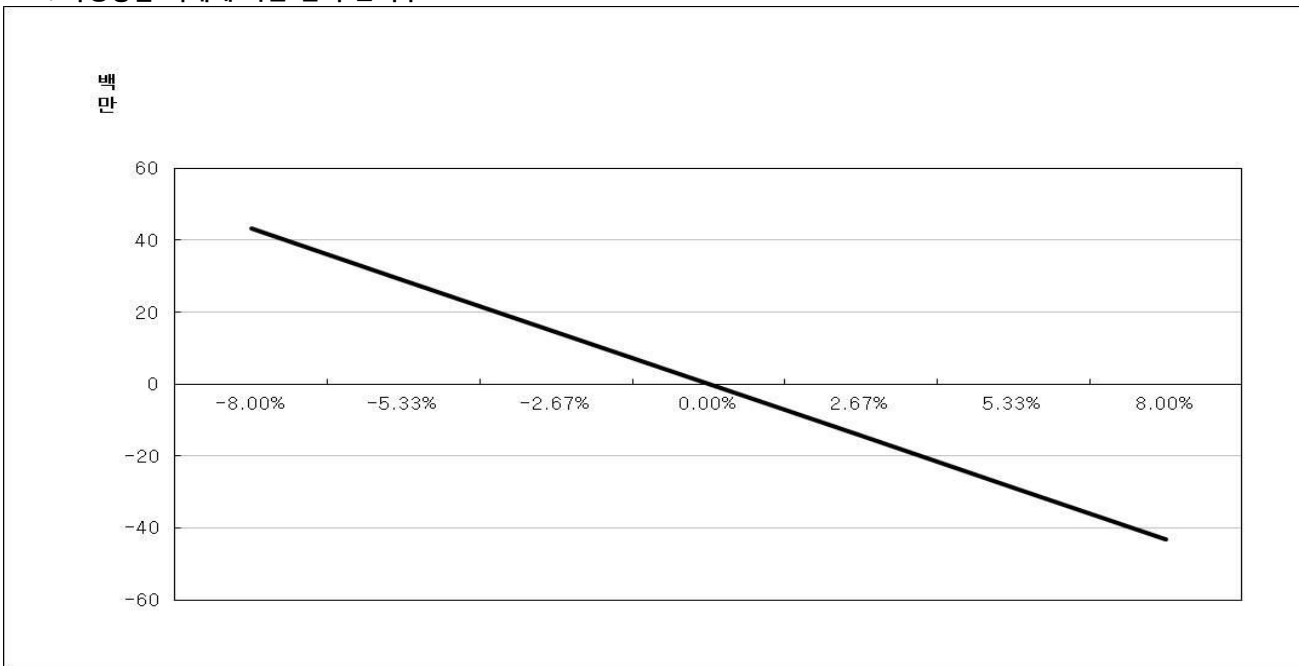
공시일: 2021-02-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	383	115	268	장내
누계	주식	주식	4,509	0	4,509	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,304	-1,304	장내
합계			4,509	1,304	3,204	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

508

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

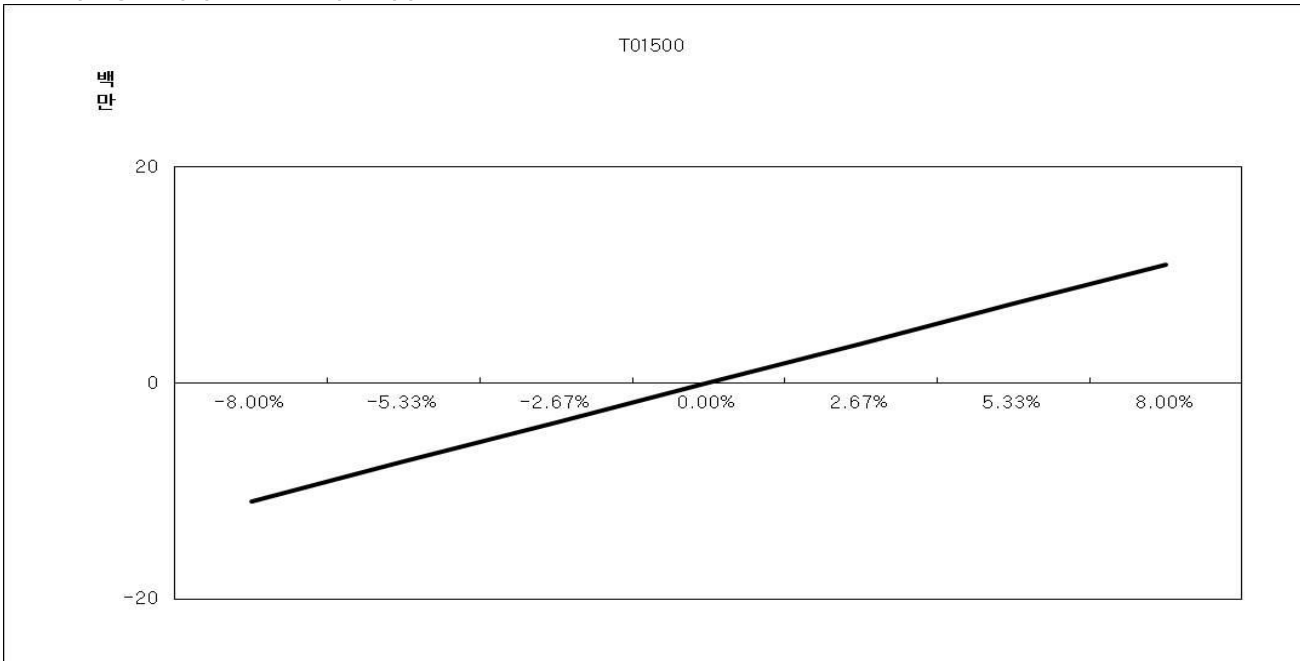
공시일: 2021-02-25

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	731	0	731	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	381	-381	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4,077	4,349	-272	장외
합계			4,808	4,730	78	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

232