

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-03-04

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	420	0	420	장내
신규	주식	주식	6	6	0	장내
누계	주식	주식	10,740	0	10,740	장내
합계			11,160	0	11,160	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,569

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

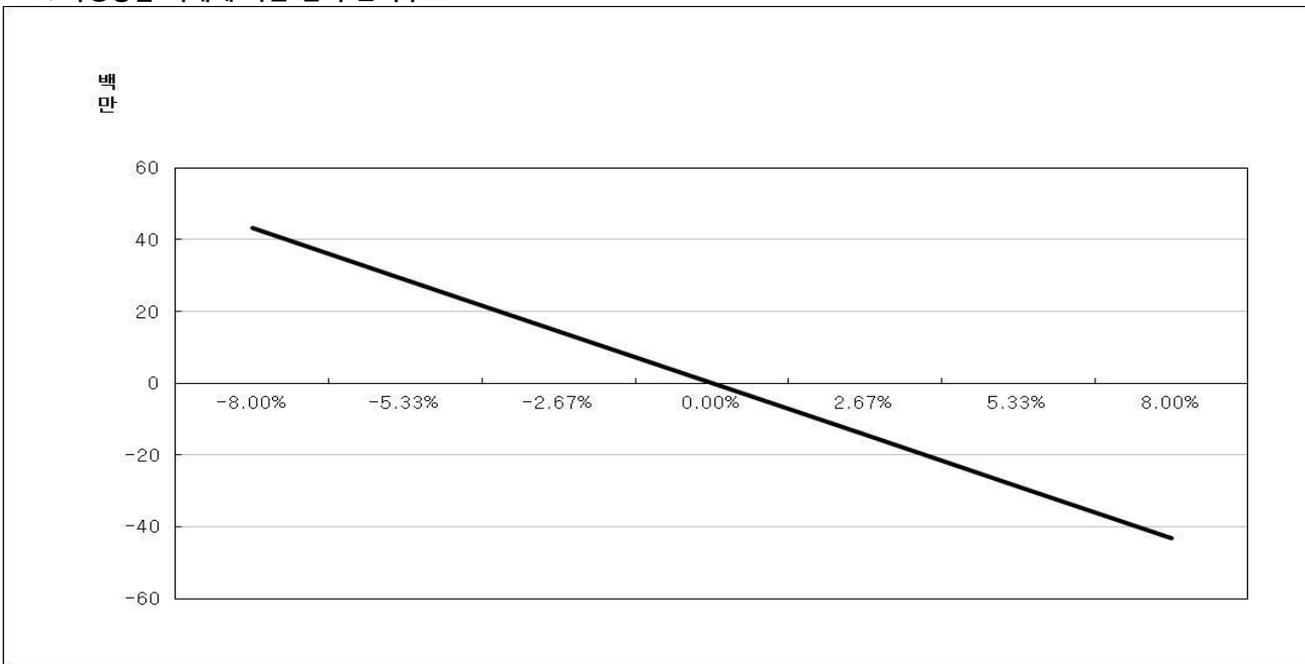
공시일: 2021-03-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	71	0	71	장내
누계	주식	주식	4,949	0	4,949	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,347	-1,347	장내
합계			4,949	1,347	3,603	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

579

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

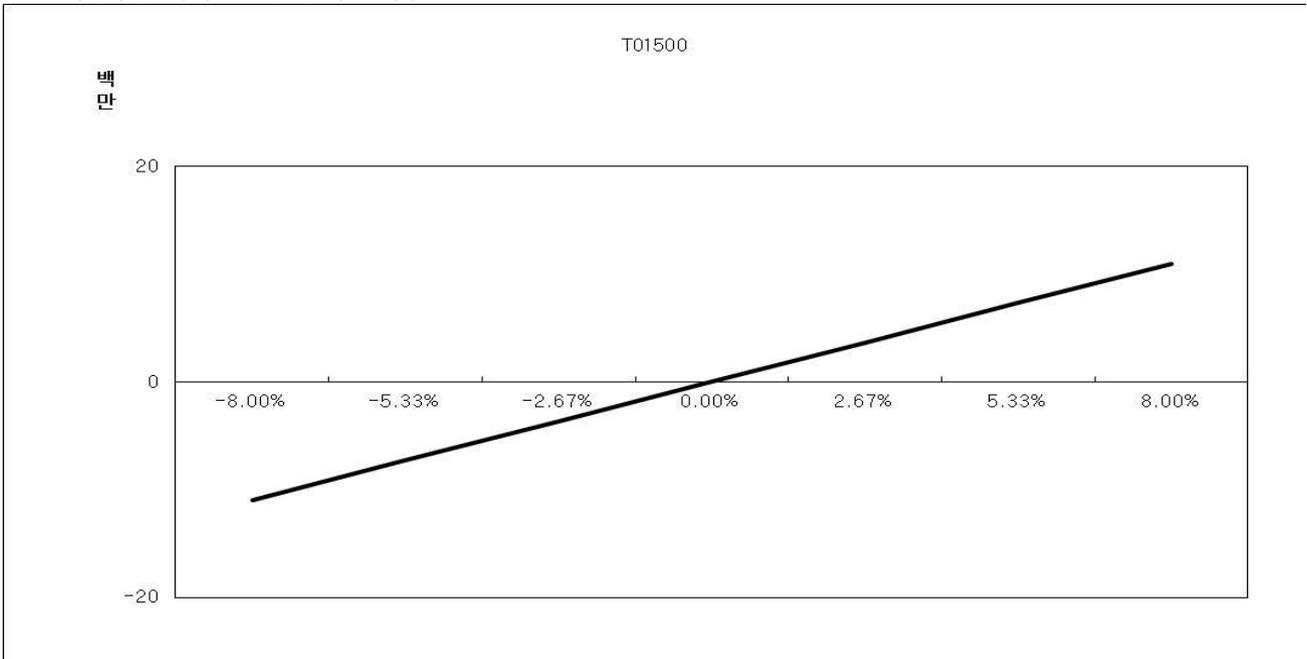
공시일: 2021-03-04

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	798	0	798	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	385	-385	장내
신규	주가지수	스왑	118	46	72	장외
누계	주가지수	스왑	4,234	4,142	92	장외
합계			5,032	4,527	505	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

240