

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-04-26

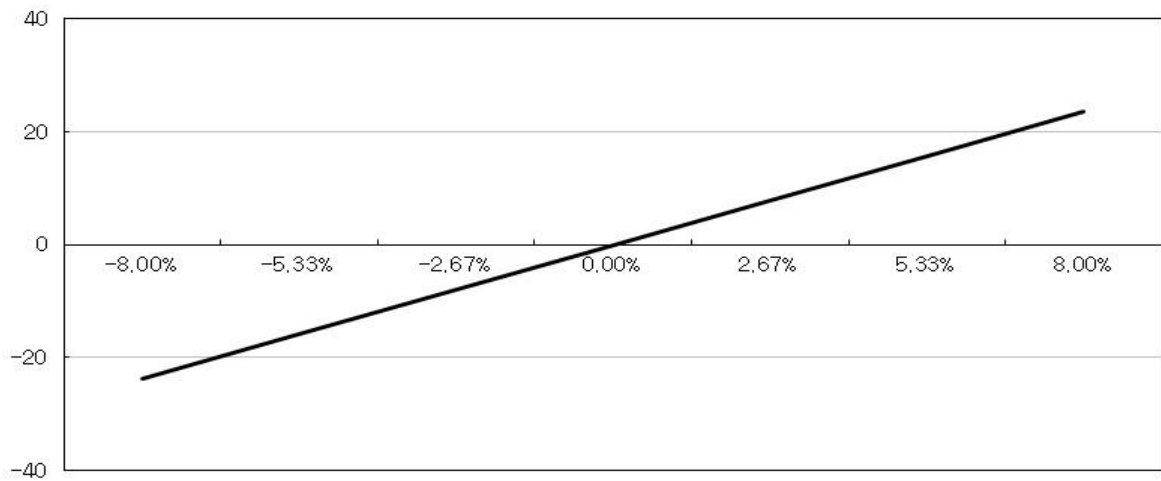
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	1,071	-1,071	장내
누계	주가지수	선물	3,320	0	3,320	장내
신규	주식	주식	0	1	-1	장내
누계	주식	주식	11,023	0	11,023	장내
합계			14,343	0	14,343	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

265

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,350

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

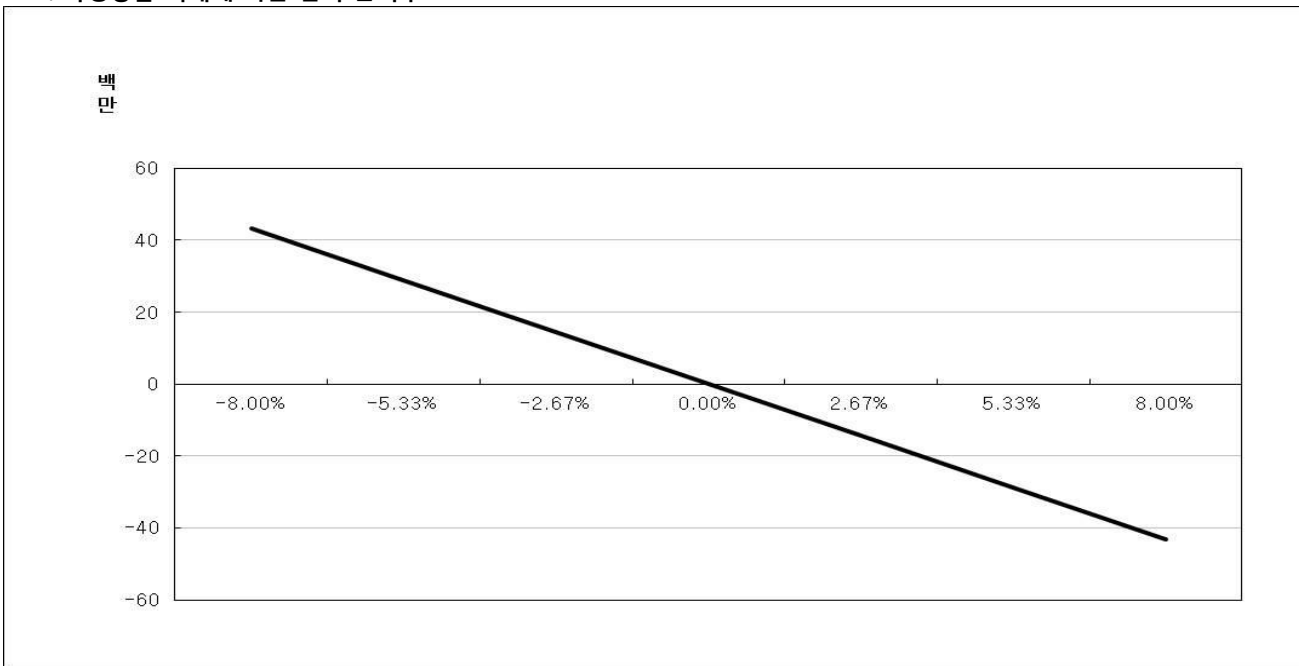
공시일: 2021-04-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	80	131	-51	장내
누계	주식	주식	4,523	0	4,523	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,408	-1,408	장내
합계			4,523	1,408	3,115	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

387

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

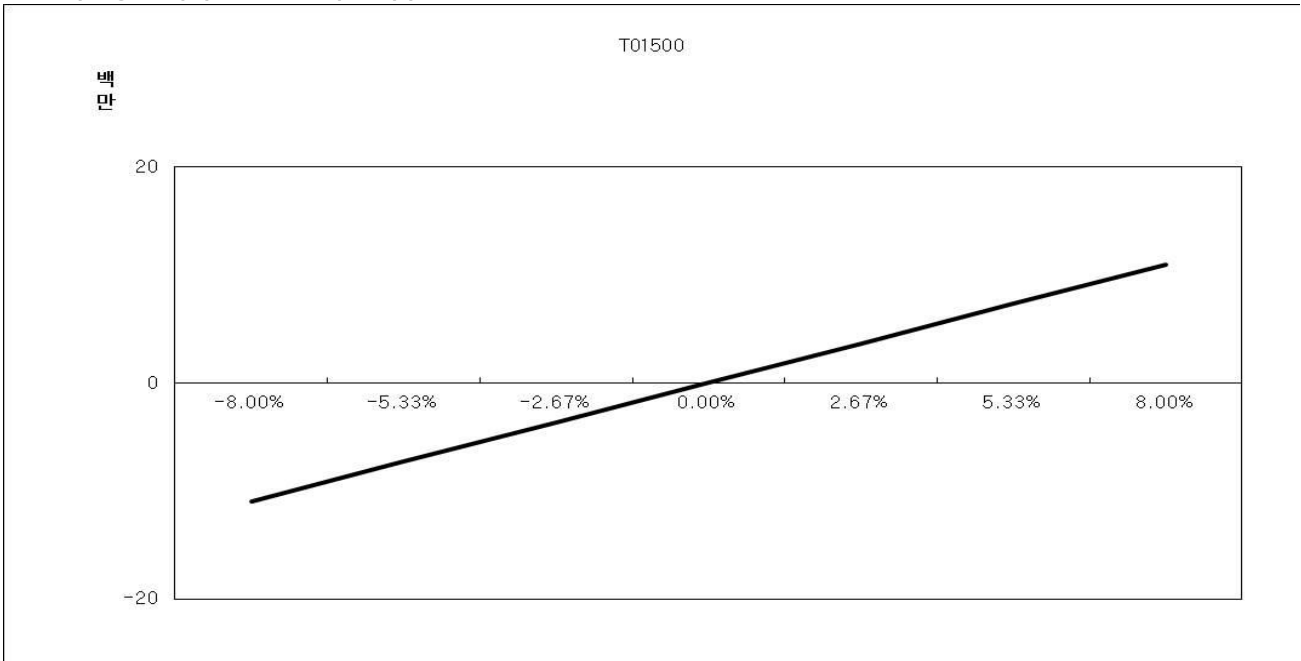
공시일: 2021-04-26

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	1,016	0	1,016	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	604	-604	장내
신규	주가지수	스왑	104	56	48	장외
누계	주가지수	스왑	3,405	3,194	211	장외
합계			4,420	3,798	622	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

200