

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-05-06

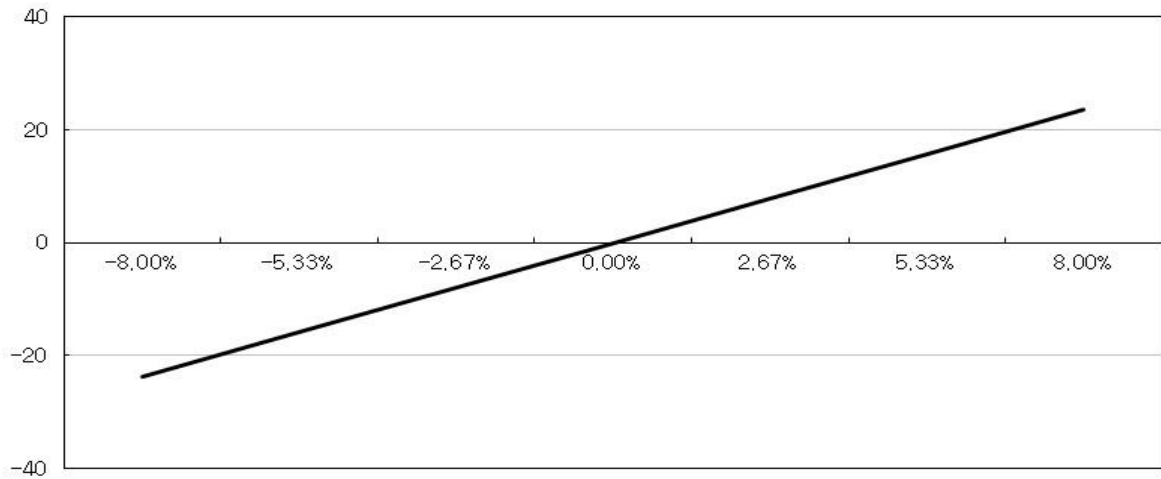
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 3,283 | 0 | 3,283 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 10,895 | 0 | 10,895 | 장내 |
| 합계 | | | 14,177 | 0 | 14,177 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

262

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,305

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

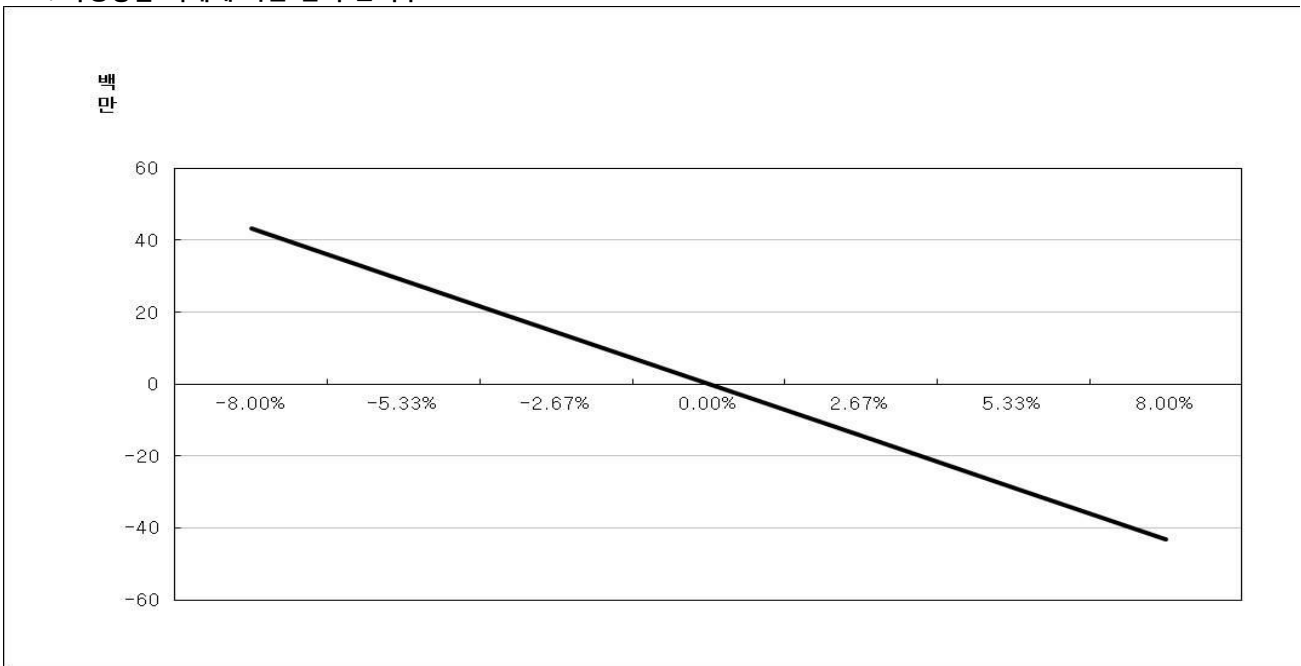
공시일: 2021-05-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 73 | 414 | -341 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 3,652 | 155 | 3,497 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 1,249 | -1,249 | 장내 |
| 합계 | | | 3,652 | 1,404 | 2,248 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

338

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

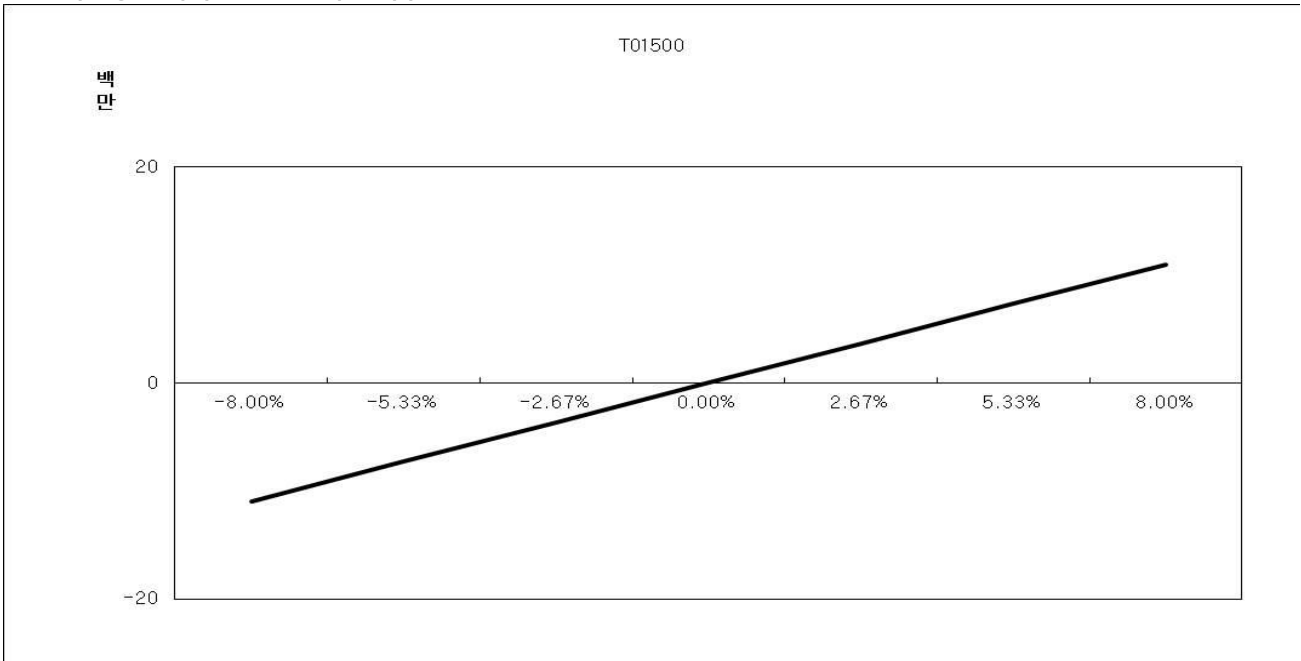
공시일: 2021-05-06

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 | 276 | 0 | 276 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 40 | -40 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 880 | 755 | 125 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 2,506 | 2,075 | 431 | 장외 |
| 합계 | | | 2,782 | 2,116 | 667 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

160