

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-05-10

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	3,321	0	3,321	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,023	0	11,023	장내
합계			14,344	0	14,344	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

266

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,327

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

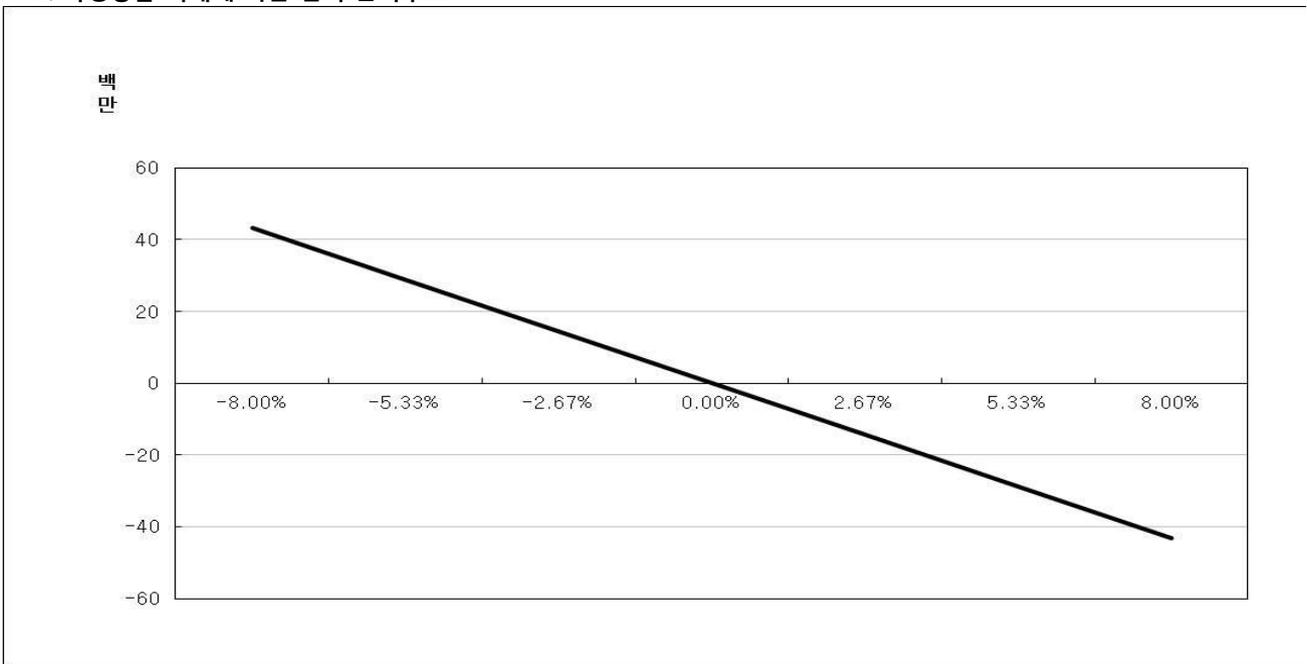
공시일: 2021-05-10

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	66	46	20	장내
누계	주식	주식	3,800	157	3,643	장내
신규	유가증권	선물	58	0	58	장내
누계	유가증권	선물	0	1,212	-1,212	장내
합계			3,800	1,369	2,430	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

345

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

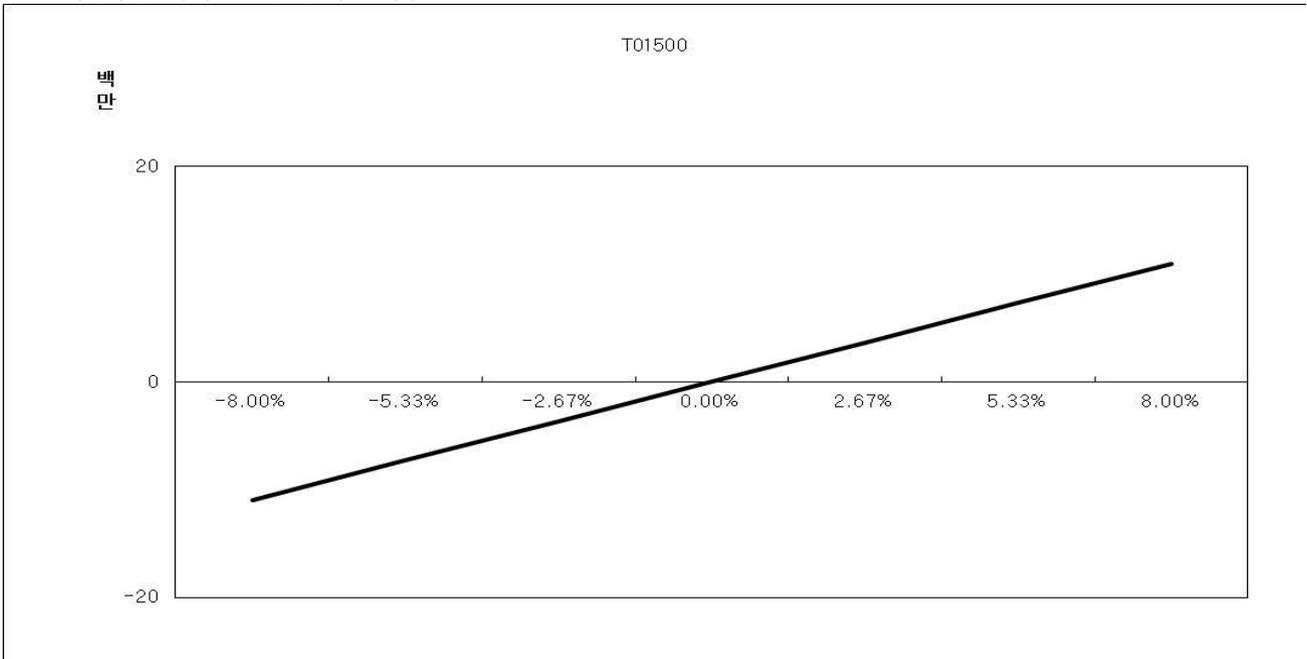
공시일: 2021-05-10

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	281	0	281	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	41	-41	장내
신규	주가지수	스왑	443	515	-72	장외
누계	주가지수	스왑	1,630	1,375	254	장외
합계			1,911	1,416	495	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

126