

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2021-05-11

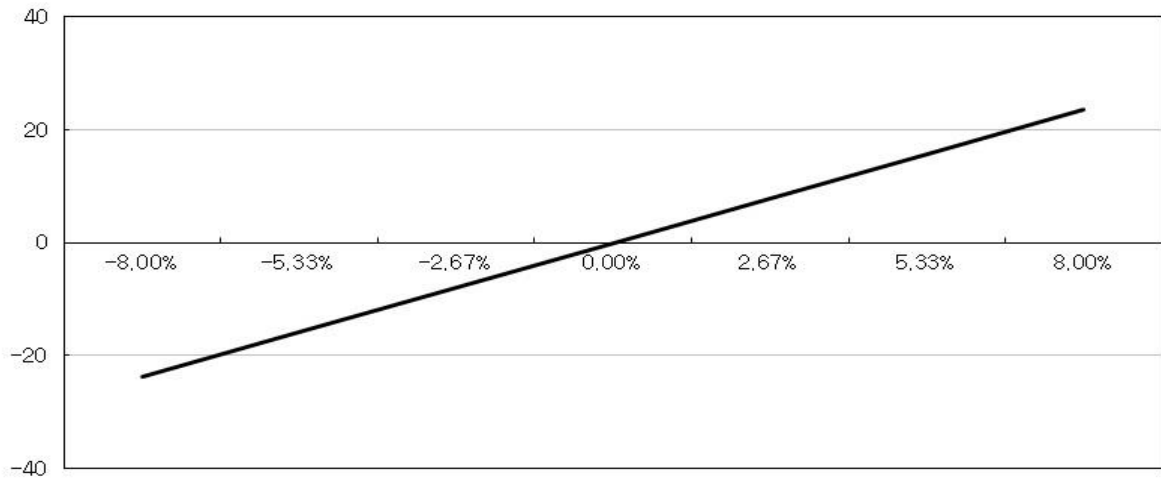
1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	3,376	0	3,376	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,204	0	11,204	장내
합계			14,581	0	14,581	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

270

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,353

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

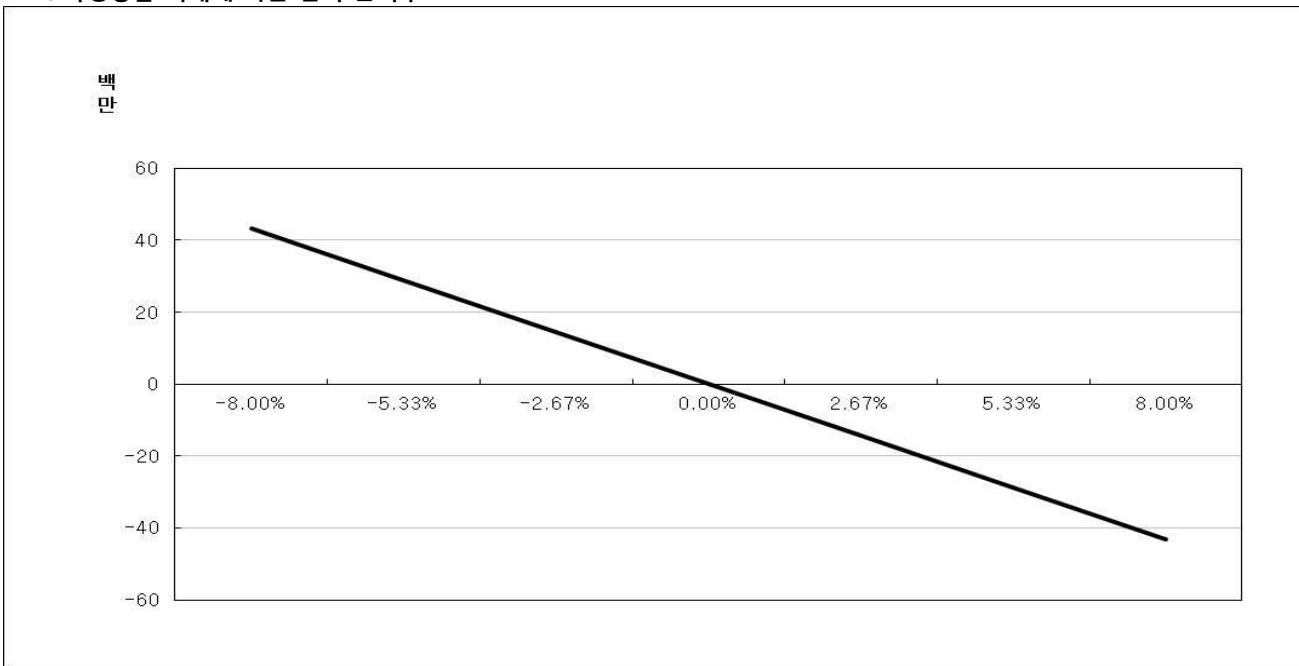
공시일: 2021-05-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	211	85	126	장내
누계	주식	주식	3,960	162	3,798	장내
신규	유가증권	선물	154	0	154	장내
누계	유가증권	선물	0	1,095	-1,095	장내
합계			3,960	1,257	2,703	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

362

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

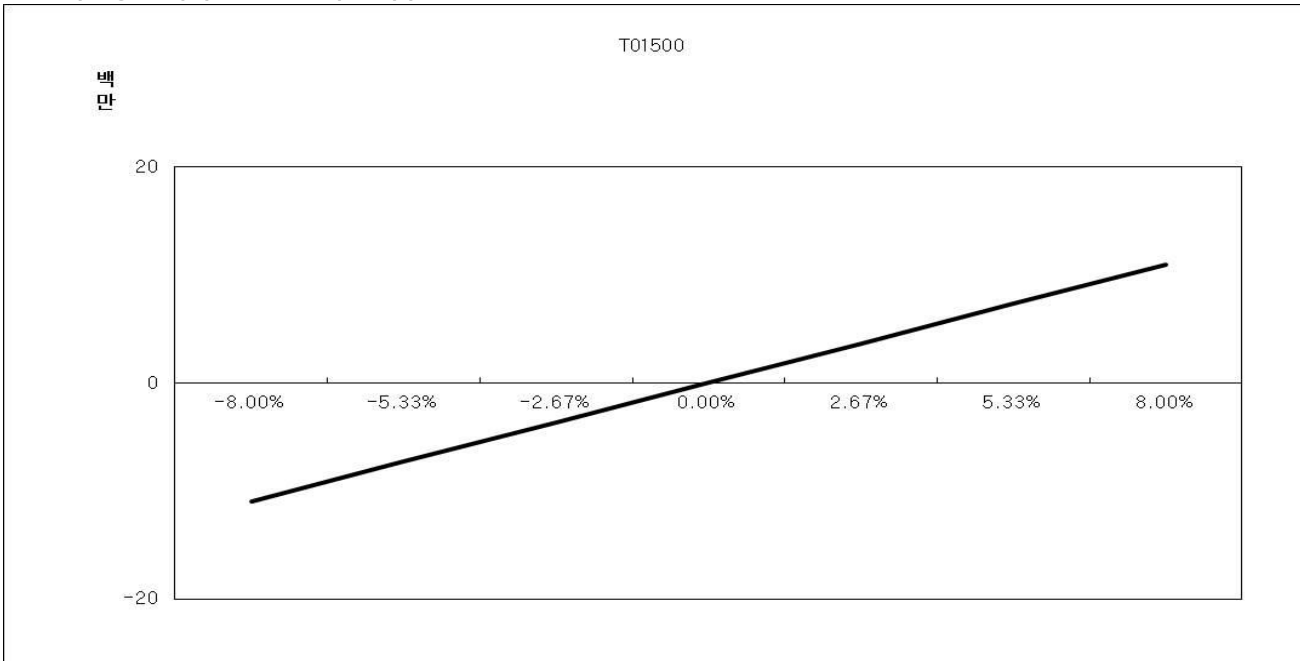
공시일: 2021-05-11

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	42	-42	장내
신규	주가지수	스왑	3,023	3,023	0	장외
누계	주가지수	스왑	1,642	1,386	256	장외
합계			1,923	1,428	496	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

126