

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-03-13

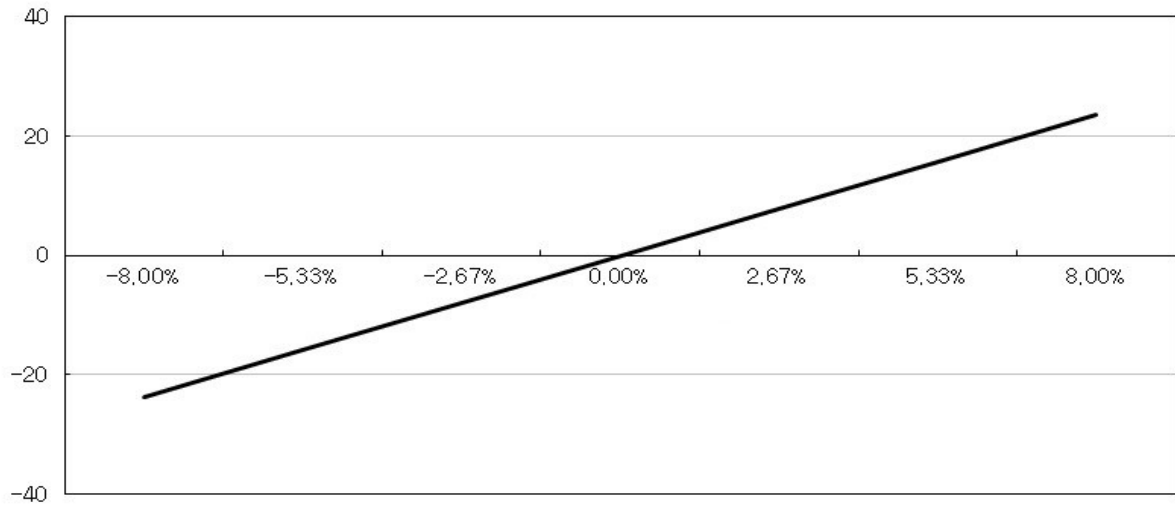
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 25 | -25 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 6,271 | 0 | 6,271 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 62 | 0 | 62 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 124 | 0 | 124 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 41 | 41 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 41 | 0 | 41 | 장내 |
| 합계 | | | 6,436 | 0 | 6,436 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

10

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

529

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

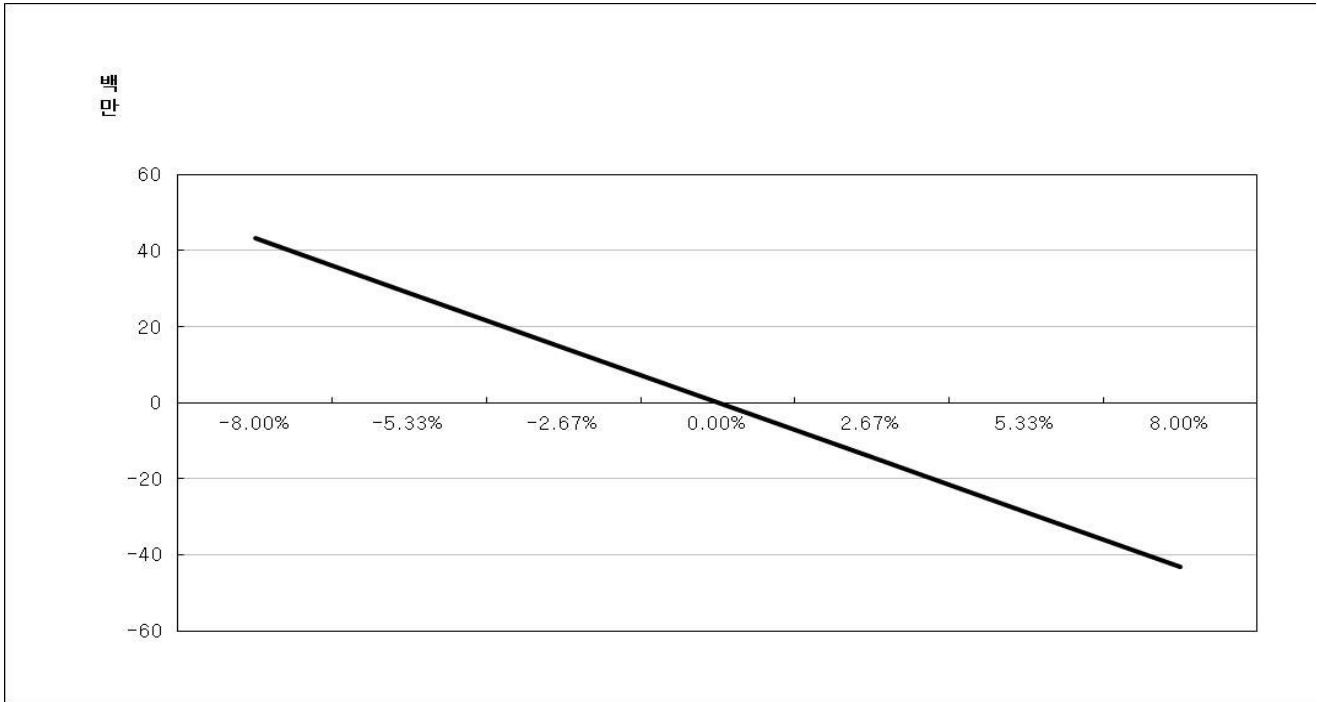
공시일: 2020-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 239 | 0 | 239 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 7,383 | 1,320 | 6,063 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 249 | -249 | 장내 |
| 합계 | | | 7,383 | 1,569 | 5,814 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

20

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

600

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

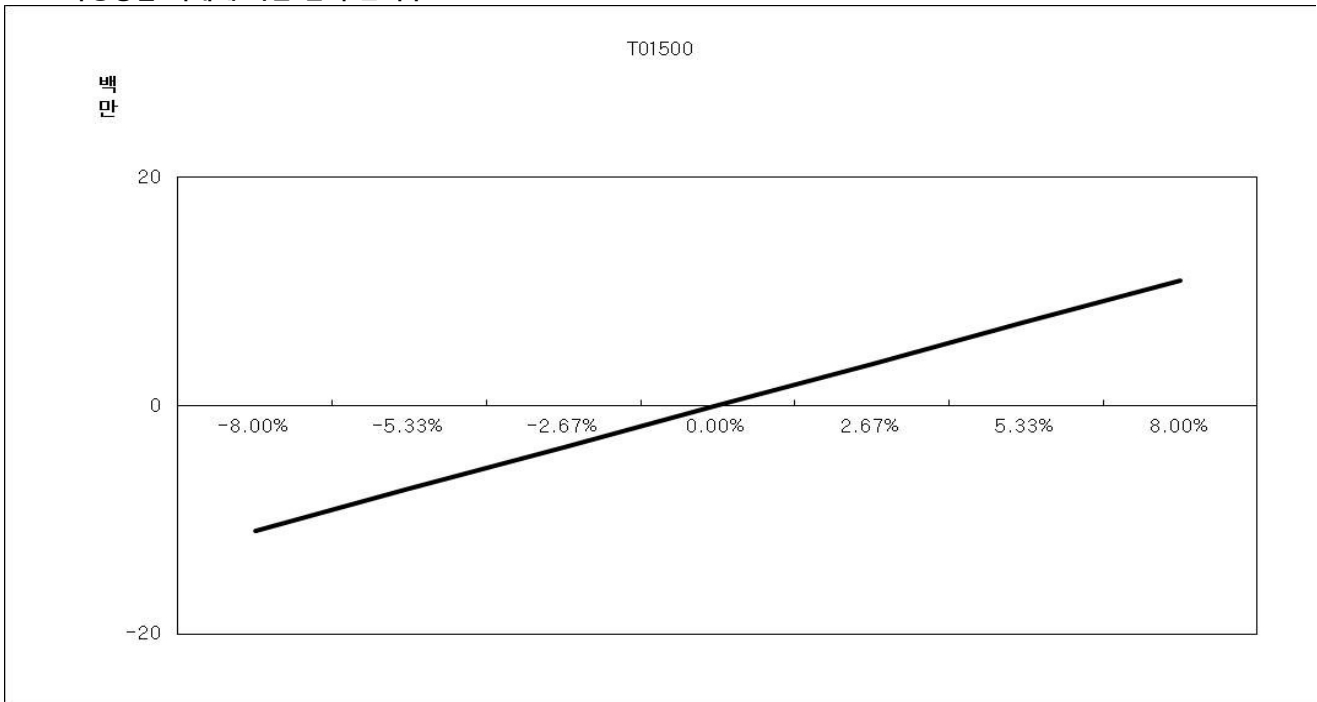
공시일: 2020-03-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 21 | 0 | 21 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 770 | 0 | 770 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 22,455 | 0 | 22,455 | 장외 |
| 합계 | | | 27,108 | 3,883 | 23,225 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

0

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

702