

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2019-09-11

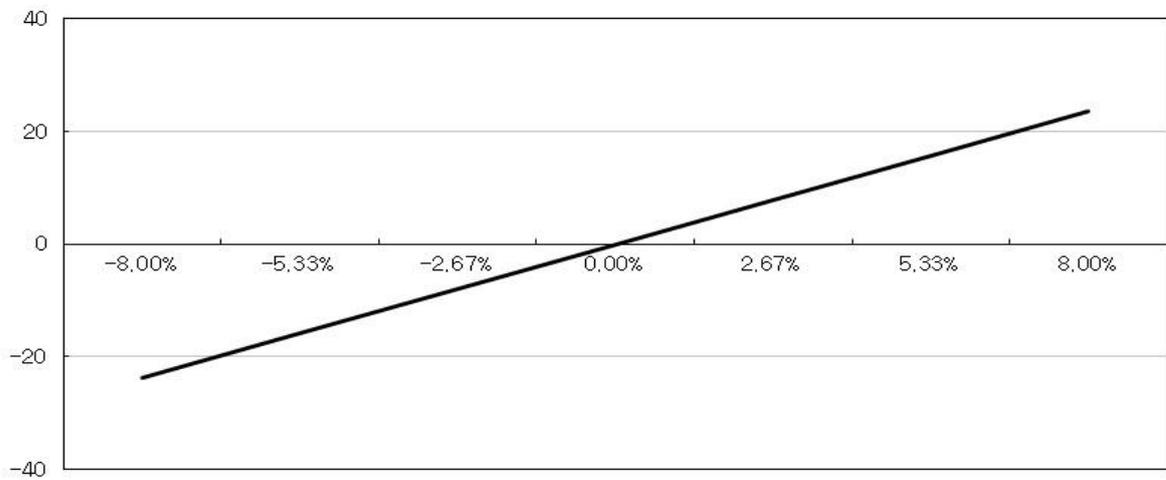
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 4 | 17 | -13 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 4,766 | 0 | 4,766 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 3,964 | 0 | 3,964 | 장내 |
| 합계 | | | 8,730 | 0 | 8,730 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

317

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

573

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

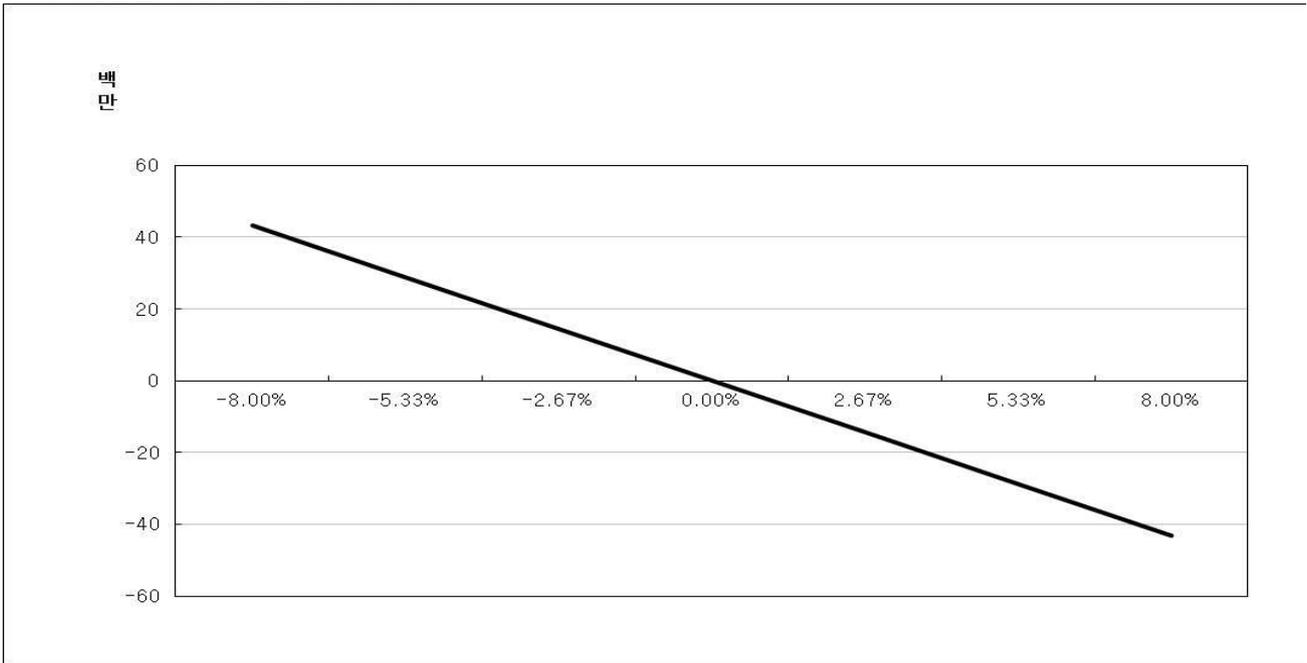
공시일: 2019-09-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 230 | -230 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 8,687 | 1,101 | 7,586 | 장내 |
| 합계 | | | 8,687 | 1,101 | 7,586 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

0

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

691

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

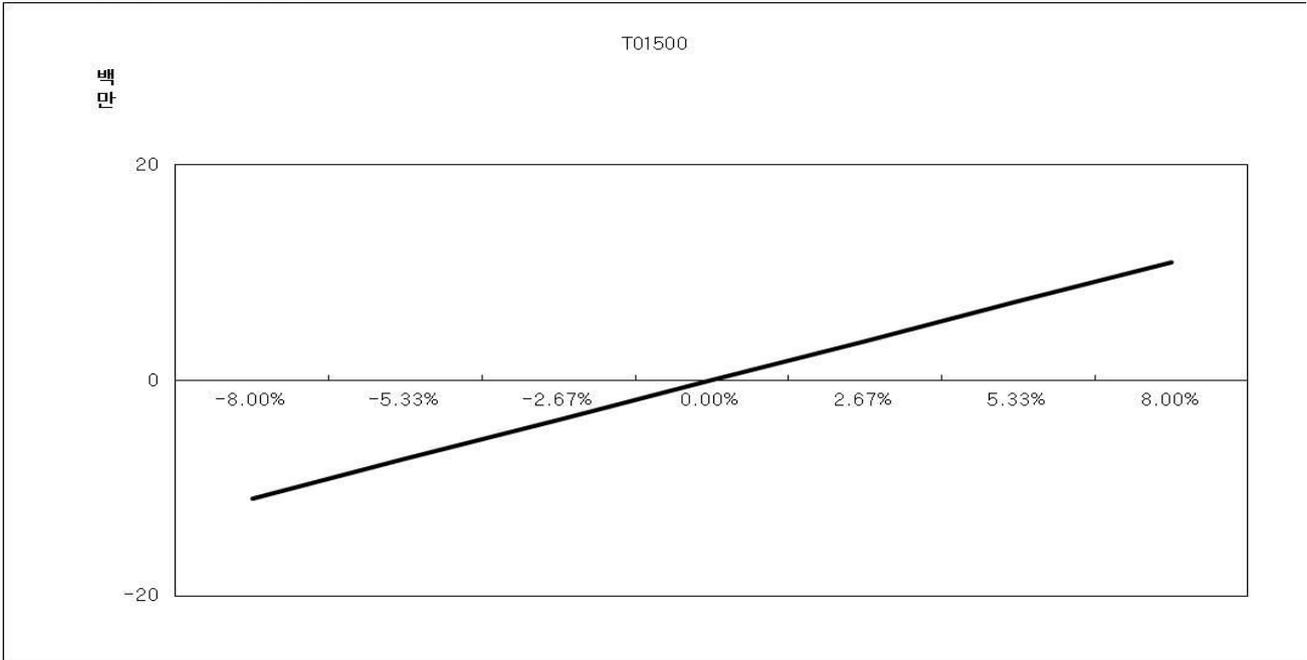
공시일: 2019-09-11

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 | 789 | 0 | 789 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 4 | 0 | 4 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 11,724 | 0 | 11,724 | 장외 |
| 합계 | | | 16,282 | 3,769 | 12,513 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

337