

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2019-10-16

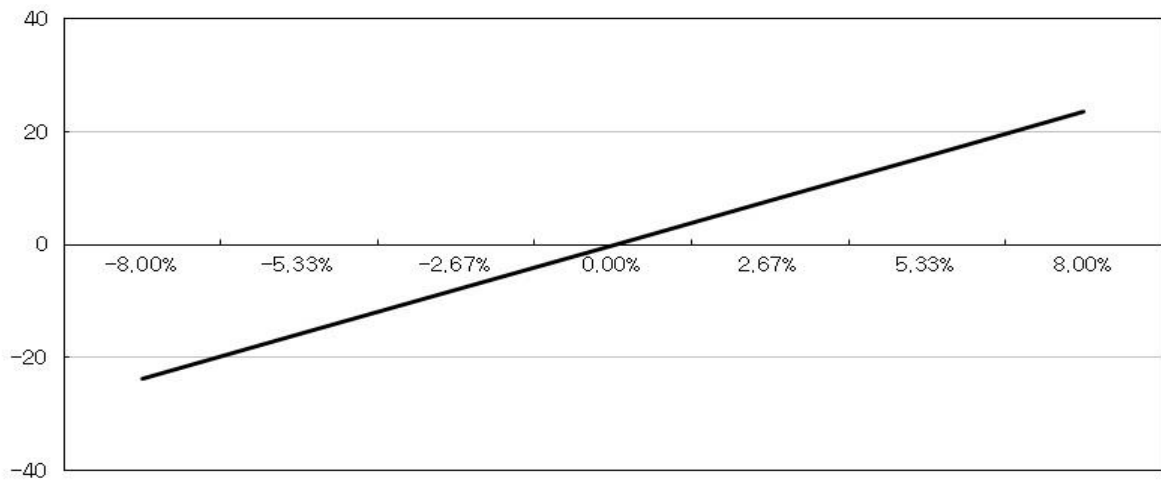
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 6,158 | 0 | 6,158 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 2,743 | 0 | 2,743 | 장내 |
| 합계 | | | 8,901 | 0 | 8,901 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

220

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

495

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2019-10-16

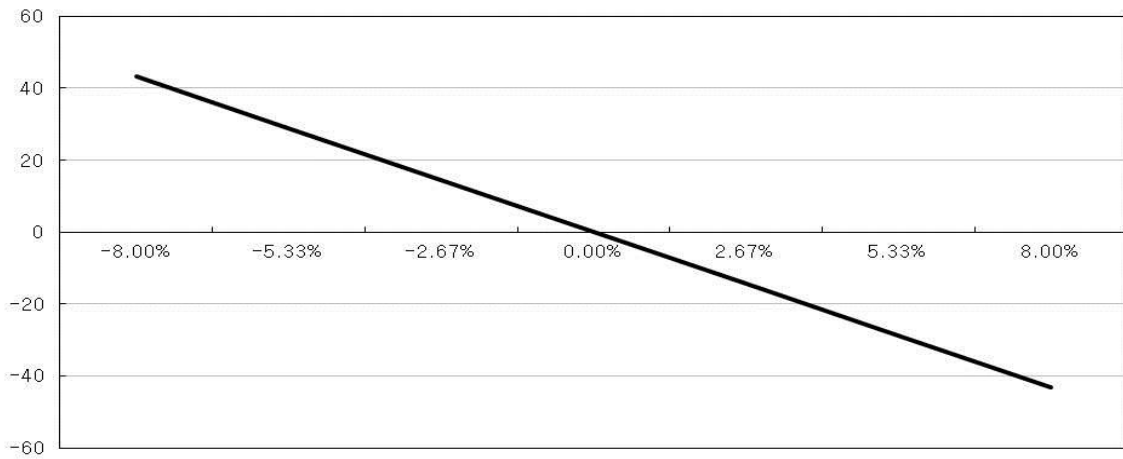
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 90 | 96 | -6 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 6,764 | 1,778 | 4,986 | 장내 |
| 합계 | | | 6,764 | 1,778 | 4,986 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

438

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

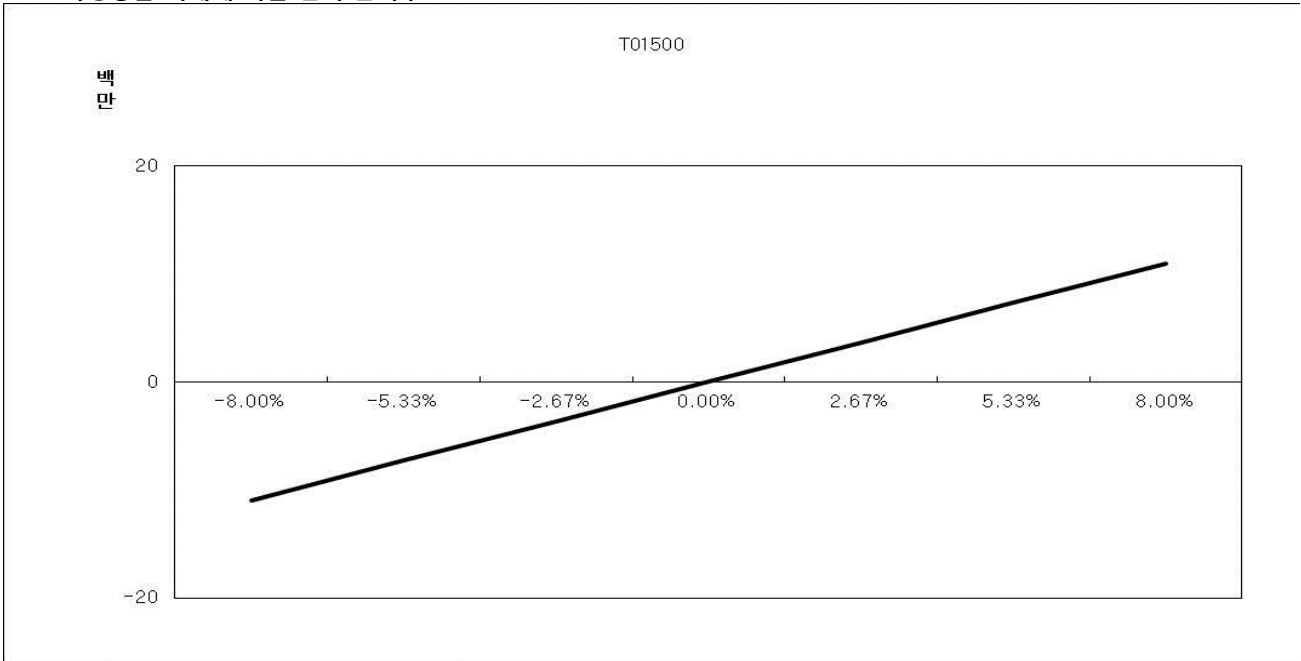
공시일: 2019-10-16

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 | 663 | 0 | 663 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 3,031 | 0 | 3,031 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 10,166 | 0 | 10,166 | 장외 |
| 합계 | | | 14,730 | 3,901 | 10,829 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

289