

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-02-25

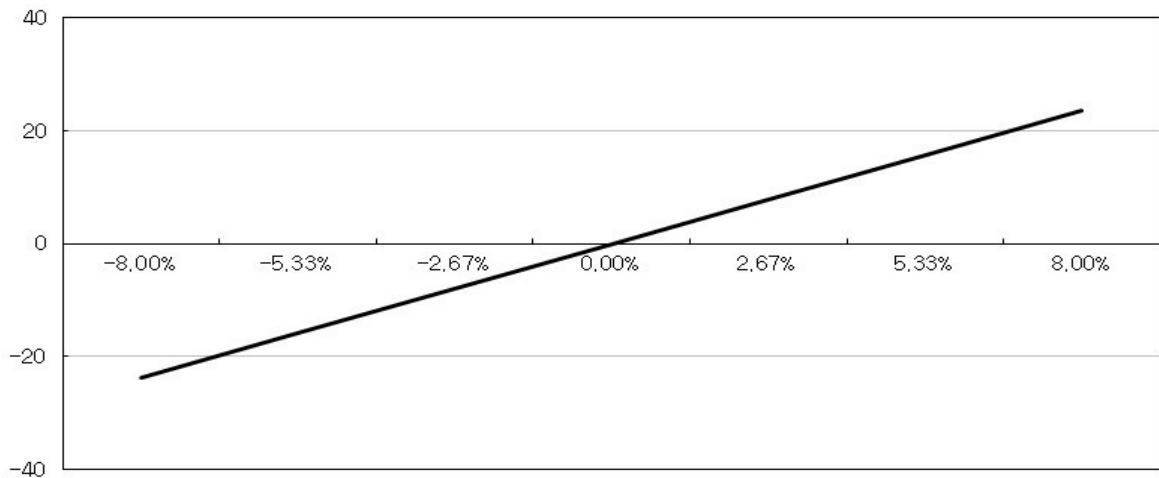
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 8 | -8 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 7,073 | 0 | 7,073 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 70 | 0 | 70 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 57 | 0 | 57 | 장내 |
| 합계 | | | 7,200 | 0 | 7,200 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

539

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

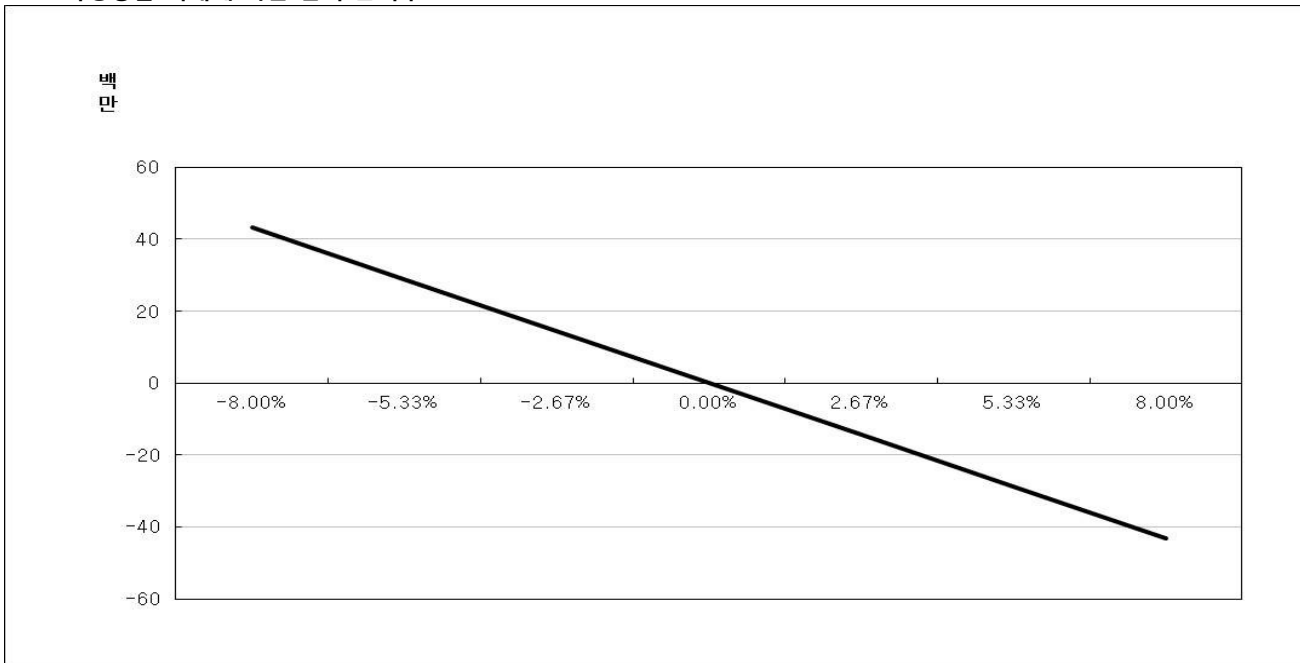
공시일: 2020-02-25

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 133 | 0 | 133 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 7,169 | 1,839 | 5,331 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 351 | 0 | 351 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 141 | -141 | 장내 |
| 합계 | | | 7,169 | 1,979 | 5,190 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

483

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

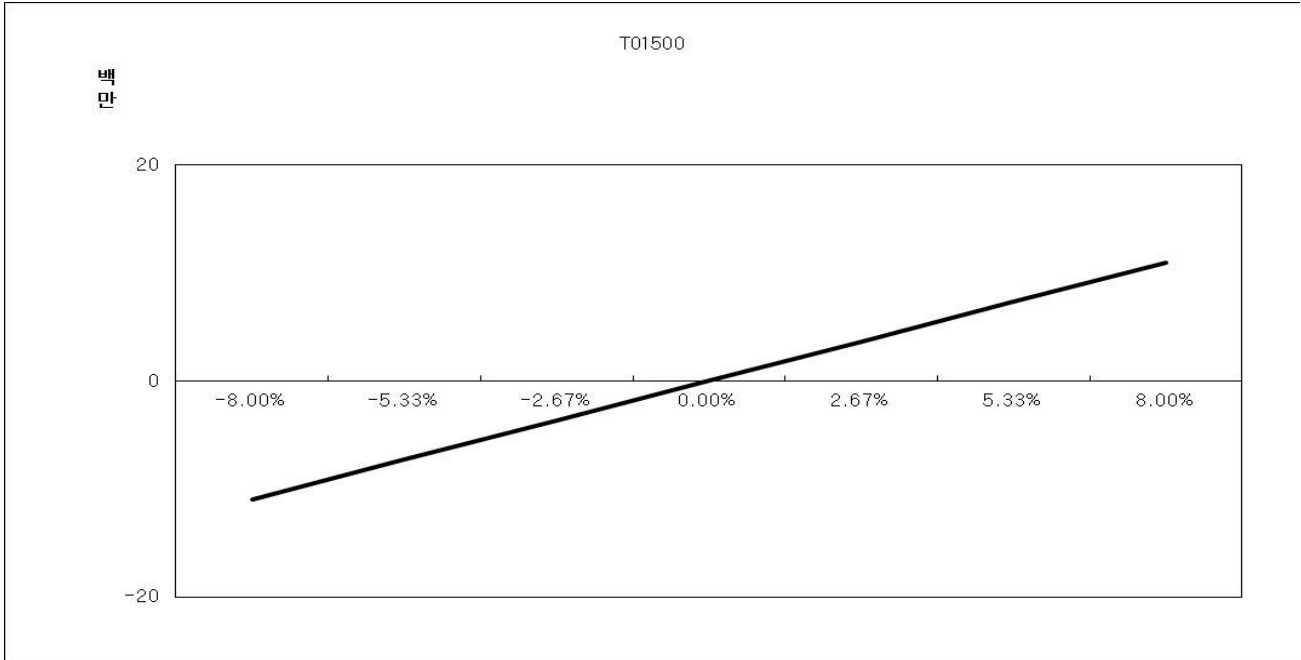
공시일: 2020-02-25

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 | 723 | 0 | 723 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 0 | 23,137 | -23,137 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 11,233 | 0 | 11,233 | 장외 |
| 합계 | | | 16,303 | 4,348 | 11,955 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

312