

# 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-09-29

## 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   | 768   | 0     | 768       | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 2     | 2     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 7,755 | 0     | 7,755     | 장내 |
| 합계 |      |      | 8,523 | 0     | 8,523     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

62

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,114

# 펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

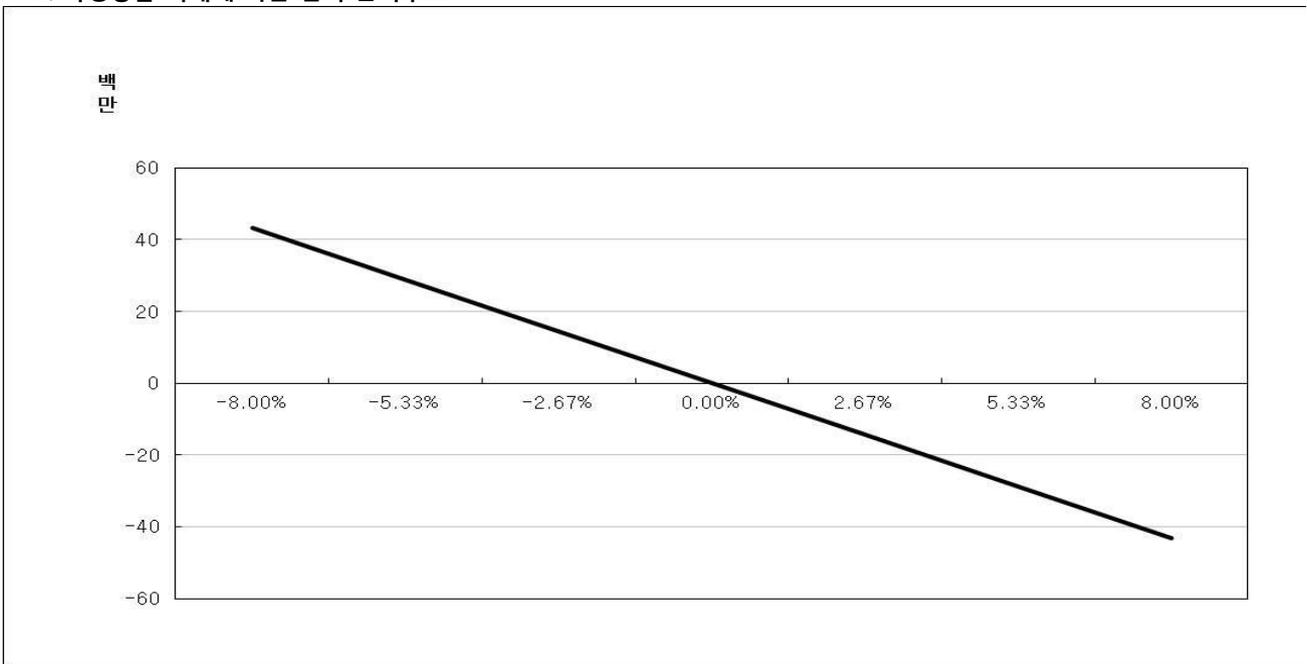
공시일: 2020-09-29

## 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | 주식   | 37    | 0     | 37        | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 3,443 | 0     | 3,443     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 1,270 | -1,270    | 장내 |
| 합계 |      |      | 3,443 | 1,270 | 2,174     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

274

# 펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

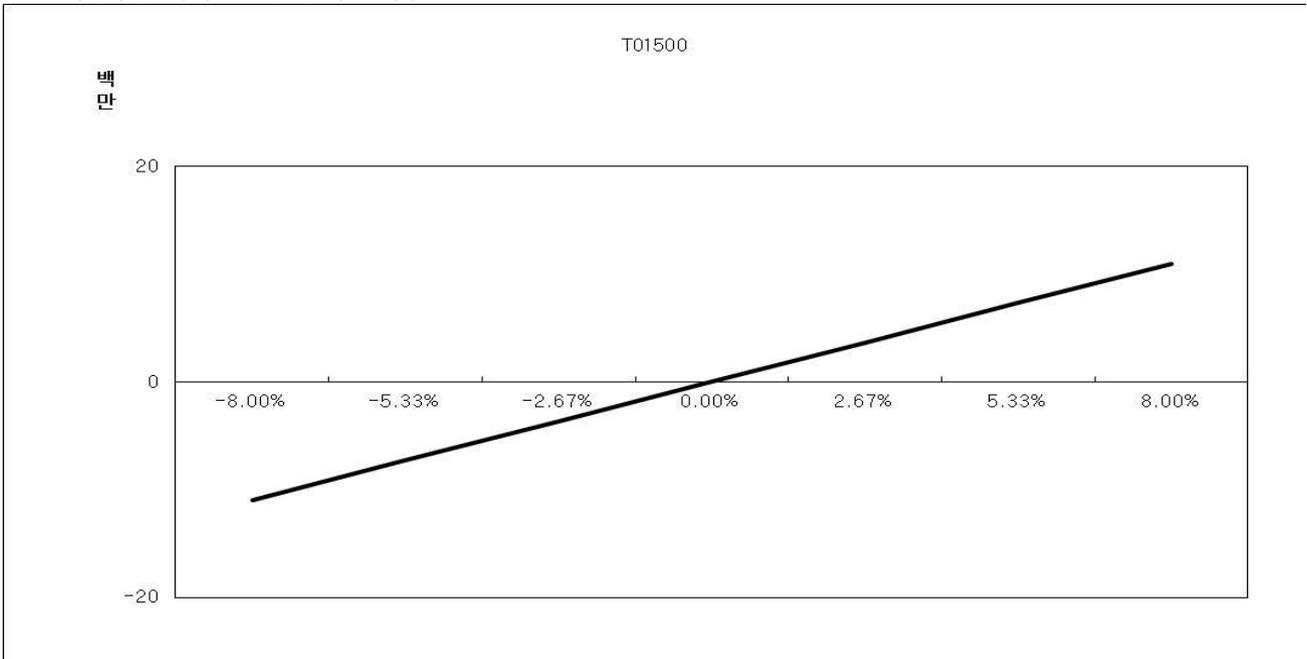
공시일: 2020-09-29

## 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   | 563   | 0     | 563       | 장내 |
| 신규 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 통화   | 선도   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 3,887 | 4,356 | -469      | 장외 |
| 합계 |      |      | 4,450 | 4,356 | 94        |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,146