

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-10-08

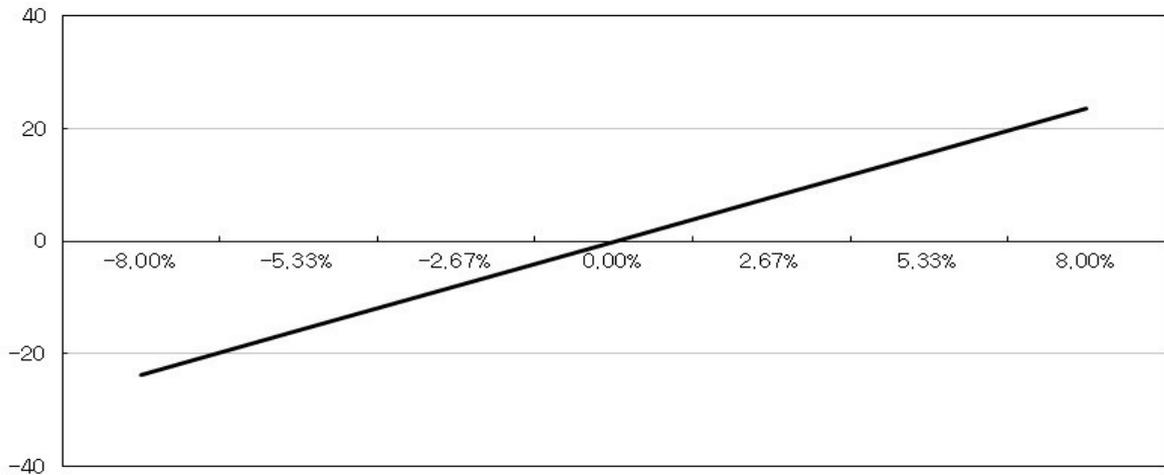
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 793 | 0 | 793 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 4 | 4 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 8,020 | 0 | 8,020 | 장내 |
| 합계 | | | 8,813 | 0 | 8,813 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

64

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,152

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-10-08

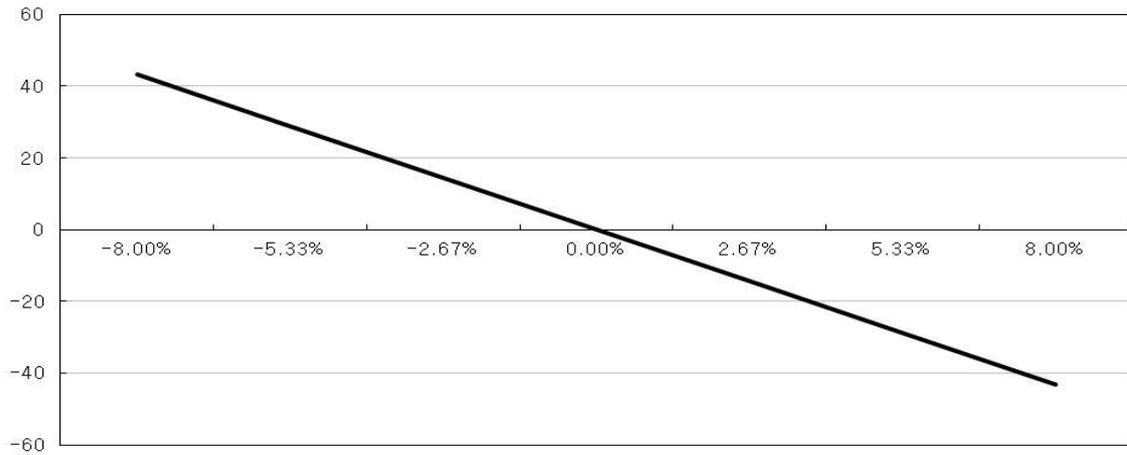
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 20 | 644 | -623 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 2,908 | 0 | 2,908 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 76 | 61 | 15 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 1,281 | -1,281 | 장내 |
| 합계 | | | 2,908 | 1,281 | 1,627 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

217

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

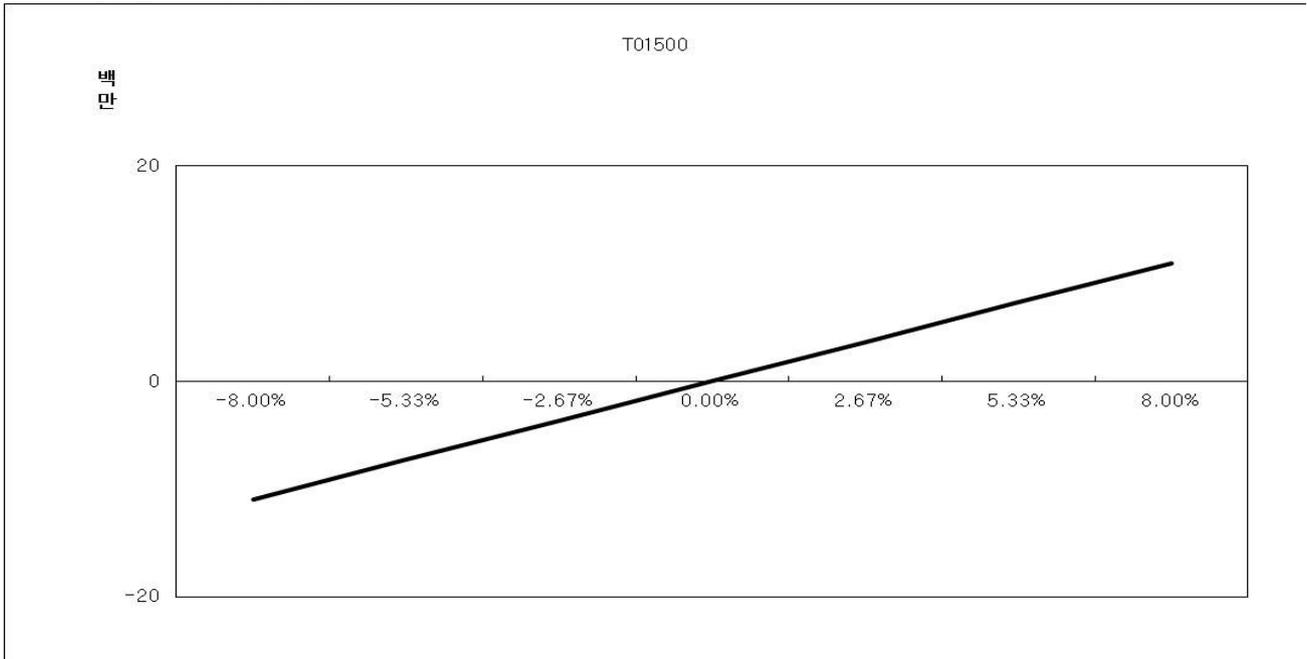
공시일: 2020-10-08

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 | 576 | 0 | 576 | 장내 |
| 신규 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 통화 | 선도 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 8,245 | 8,185 | 61 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 4,068 | 4,436 | -368 | 장외 |
| 합계 | | | 4,644 | 4,436 | 208 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

20

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,113