

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-06-30

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 | 139 | 0 | 139 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 3 | 5 | -2 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 6,878 | 0 | 6,878 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 7 | 0 | 7 | 장내 |
| 합계 | | | 7,023 | 0 | 7,023 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

935

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

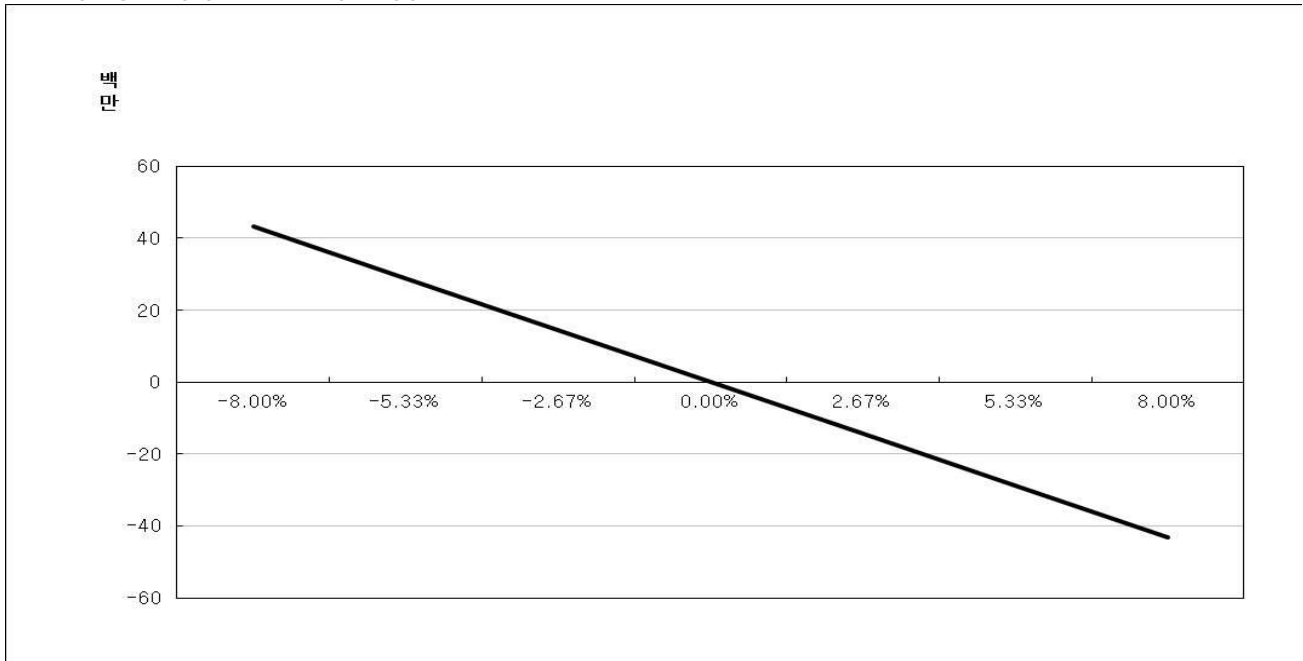
공시일: 2020-06-30

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 | 0 | 626 | -626 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 24 | 0 | 24 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 4,373 | 335 | 4,038 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 1,048 | -1,048 | 장내 |
| 합계 | | | 4,373 | 2,009 | 2,364 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

50

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

385

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-06-30

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 | 522 | 0 | 522 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 44,004 | 4,574 | 39,430 | 장외 |
| 합계 | | | 44,525 | 4,574 | 39,952 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,720