## 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일:

2019-05-07

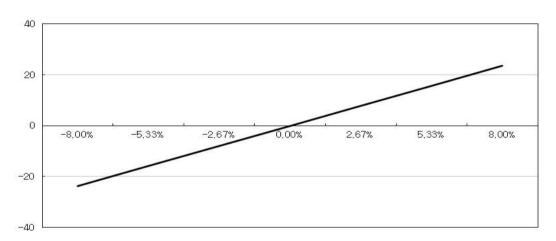
1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분     거래대상     거래유형     매수(1)     매도(2)     순포지션(1-2)     비고       신규     주식     주식     0     0     0     장내       누계     주식     주식     4,930     0     4,930     장내       신규     주가지수     선물     0     0     0     장내       누계     주가지수     선물     71     0     71     장내       합계     5,001     0     5,001     0     5,001     0 | _ |    |      |      |       |       |           | (= 11: 1= =/ |
|--|---|----|------|------|-------|-------|-----------|--------------|
| 누계 주식 주식 4,930 0 4,930 장내   신규 주가지수 선물 0 0 0 장내   누계 주가지수 선물 71 0 71 장내  |   | 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고           |
| 신규 주가지수 선물 0 0 0 장내<br>누계 주가지수 선물 71 0 71 장내   |   | 신규 | 주식   | 주식   | 0     | 0     | 0         | 장내           |
| 누계 주가지수 선물 71 0 71 장내  | Ī | 누계 | 주식   | 주식   | 4,930 | 0     | 4,930     | 장내           |
|  |   | 신규 | 주가지수 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내           |
| 합계 5,001 0 5,001   |   | 누계 | 주가지수 | 선물   | 71    | 0     | 71        | 장내           |
|  |   | 합계 |      |      | 5,001 | 0     | 5,001     |              |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백 만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

6

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원) 385

트러스톤자산운용

## 펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일:

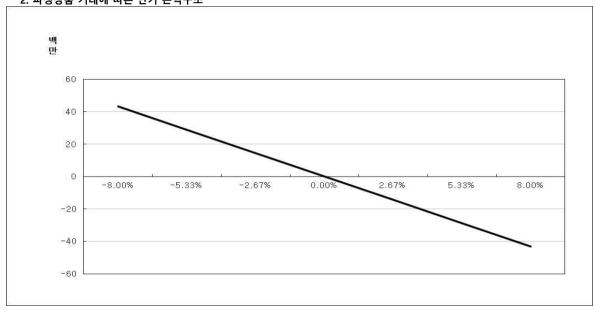
2019-05-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 거래대상 거래유형 매수(1) 매도(2) 순포지션(1-2) 비고   신규 주식 286 0 286 장내   누계 주식 주식 9,021 3,037 5,984 장내   신규 유가증권 선물 0 0 0 장내   누계 유가증권 선물 0 285 -285 장내   합계 9,021 3,323 5,698 |    |      |      |       |       |           | (= ::: !==/ |
|--|----|------|------|-------|-------|-----------|-------------|
| 누계 주식 주식 9,021 3,037 5,984 장내   신규 유가증권 선물 0 0 0 장내   누계 유가증권 선물 0 285 -285 장내   | 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고          |
| 신규 유가증권 선물 0 0 0 장내<br>누계 유가증권 선물 0 285 -285 장내  | 신규 | 주식   | 주식   | 286   | 0     | 286       | 장내          |
| 누계 유가증권 선물 0 285 -285 장내   | 누계 | 주식   | 주식   | 9,021 | 3,037 | 5,984     | 장내          |
|  | 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내          |
| 합계 9,021 3,323 5,698   | 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 285   | -285      | 장내          |
|  | 합계 |      |      | 9,021 | 3,323 | 5,698     |             |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원) 657

트러스톤자산운용

## 펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일:

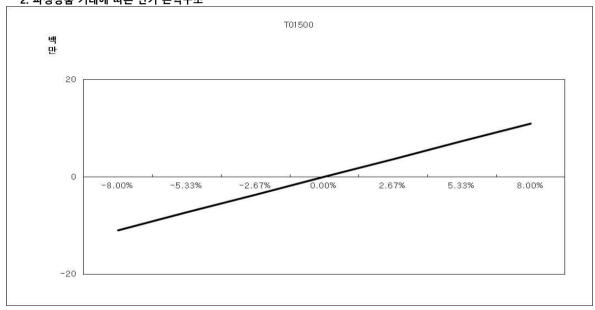
2019-05-07

1. 계약금액

(단위: 백만원)

|    |      |      |        |       |           | (611: 466) |
|----|------|------|--------|-------|-----------|------------|
| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고         |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0      | 0     | 0         | 장내         |
| 누계 | 주식   | 주식   | 1,007  | 0     | 1,007     | 장내         |
| 신규 | 주가지수 | 스왐   | 33     | 0     | 33        | 장외         |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 14,836 | 0     | 14,836    | 장외         |
| 합계 |      |      | 20,146 | 4,303 | 15,844    |            |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

13

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원) 554

트러스톤자산운용