펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

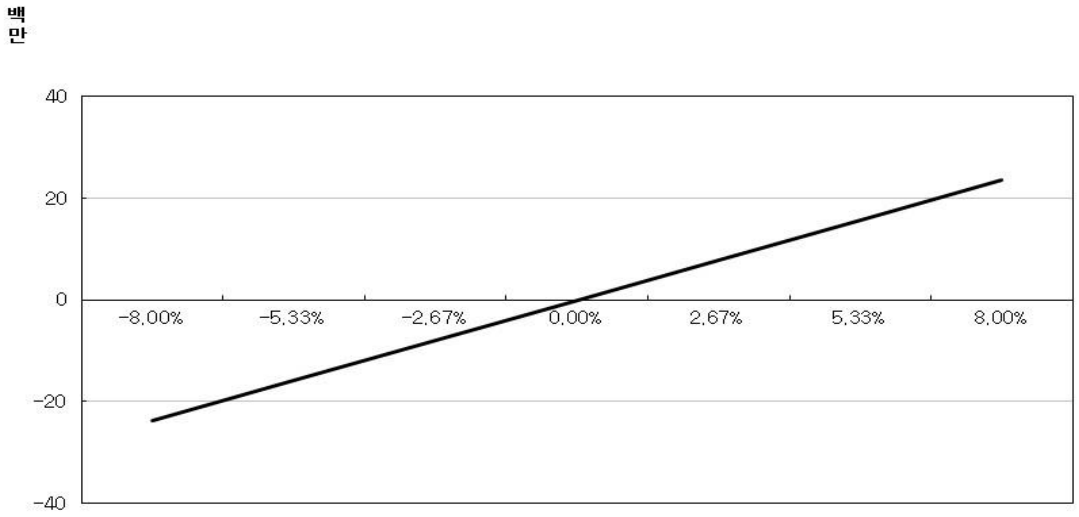
공시일: 2019-07-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	5	11	-6	장내
누계	주식	주식	4,850	0	4,850	장내
신규	주가지수	선물	0	0	0	장내
누계	주가지수	선물	69	0	69	장내
합계			4,919	0	4,919	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	6

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	360

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

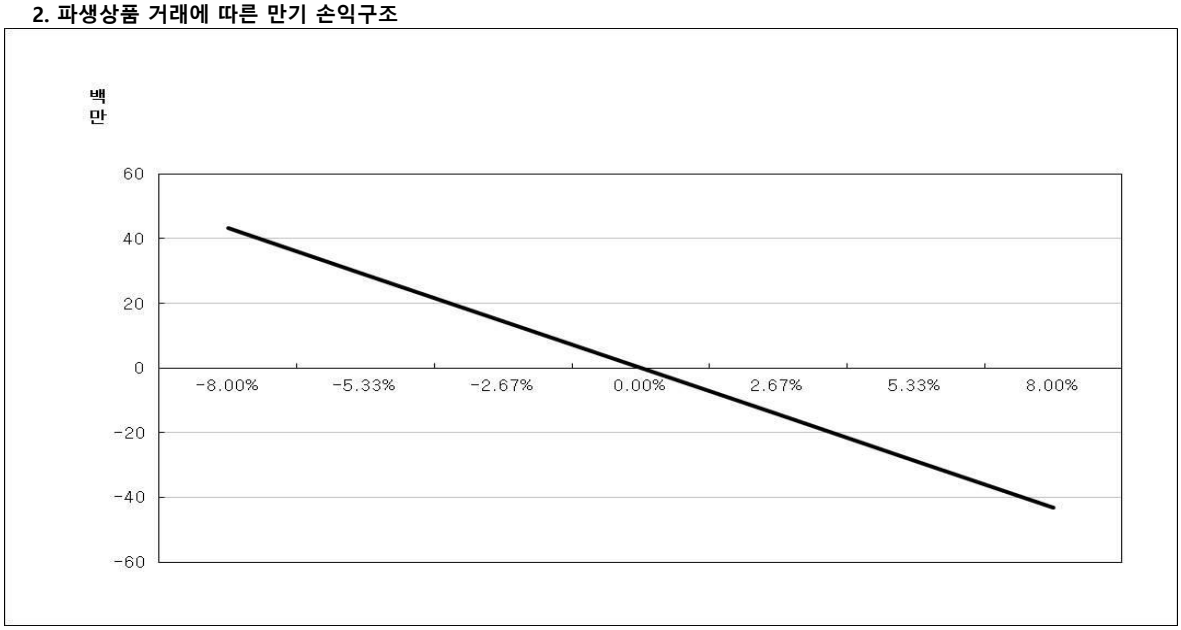
공시일: 2019-07-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	53	68	-14	장내
누계	주식	주식	13,599	2,044	11,556	장내
합계			13,599	2,044	11,556	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

868

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

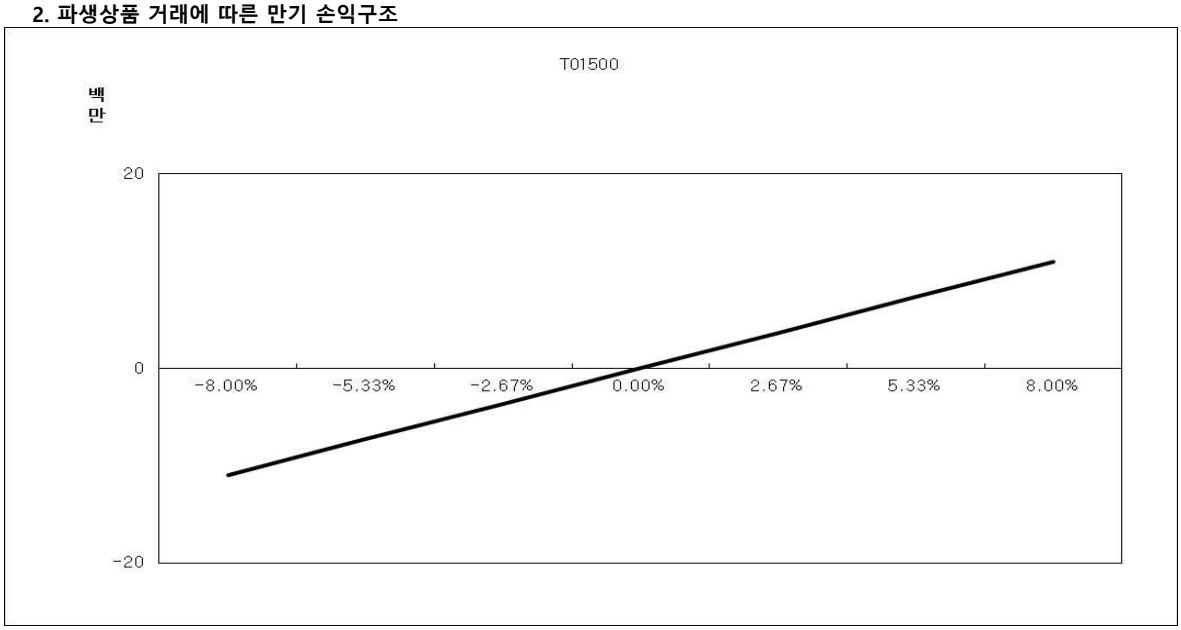
공시일: 2019-07-02

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	976	0	976	장내
신규	주가지수	스왑	30	0	30	장외
누계	주가지수	스왑	5,123	0	5,123	장외
합계			10,250	4,152	6,098	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

196