

# 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-06-05

## 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   | 716   | 0     | 716       | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 1     | 0     | 1         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 6,543 | 0     | 6,543     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 7     | 0     | 7         | 장내 |
| 합계 |      |      | 7,266 | 0     | 7,266     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

57

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

908

## 펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

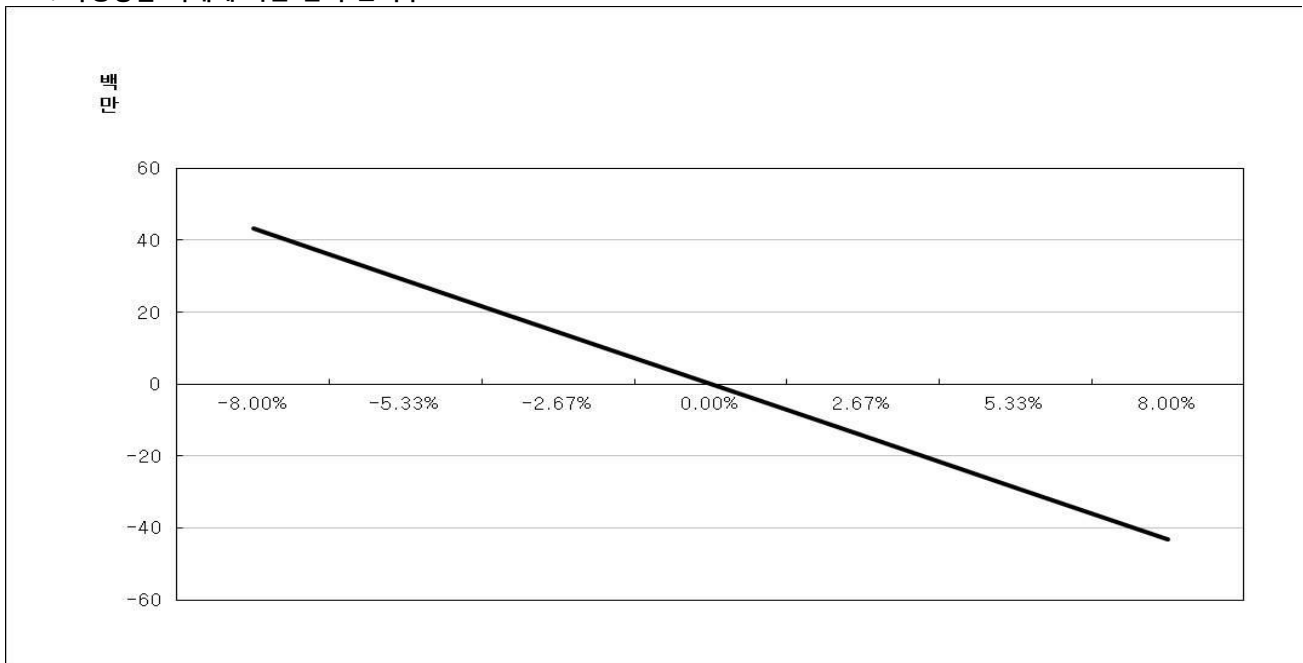
공시일: 2020-06-05

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 72    | 0     | 72        | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 0     | 716   | -716      | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0     | 143   | -143      | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 5,294 | 939   | 4,355     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 1,052 | -1,052    | 장내 |
| 합계 |      |      | 5,294 | 2,708 | 2,586     |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

57

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

375

# 펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-06-05

## 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   | 621    | 0      | 621       | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 8,854  | 10,619 | -1,765    | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 45,022 | 4,527  | 40,495    | 장외 |
| 합계 |      |      | 45,643 | 4,527  | 41,116    |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,728