펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

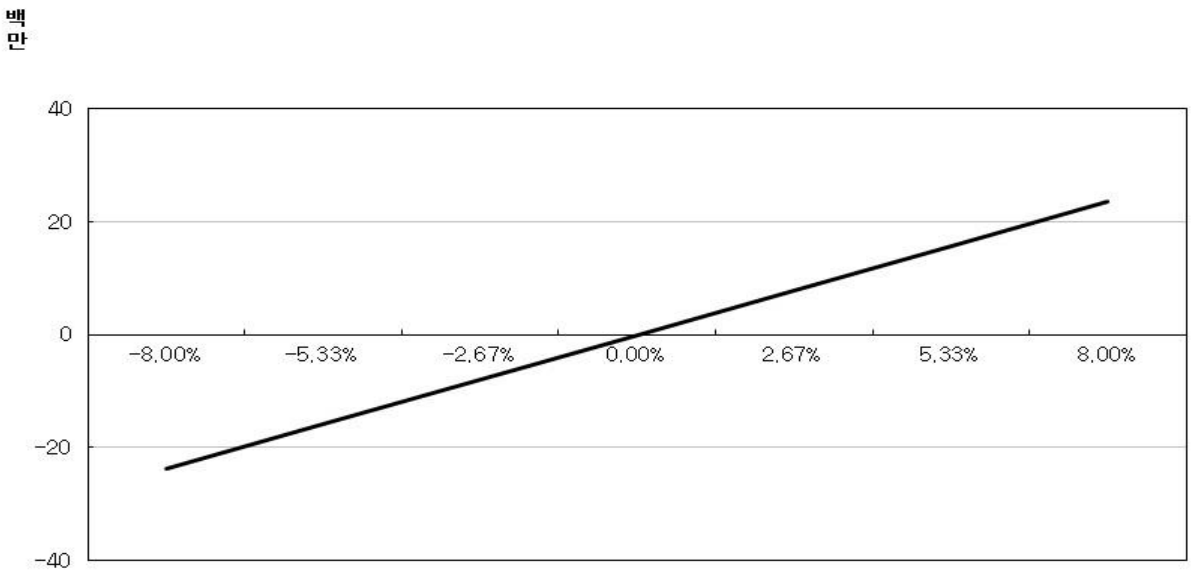
공시일: 2020-07-21

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	145	0	145	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	7,181	0	7,181	장내
합계			7,327	0	7,327	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	974

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

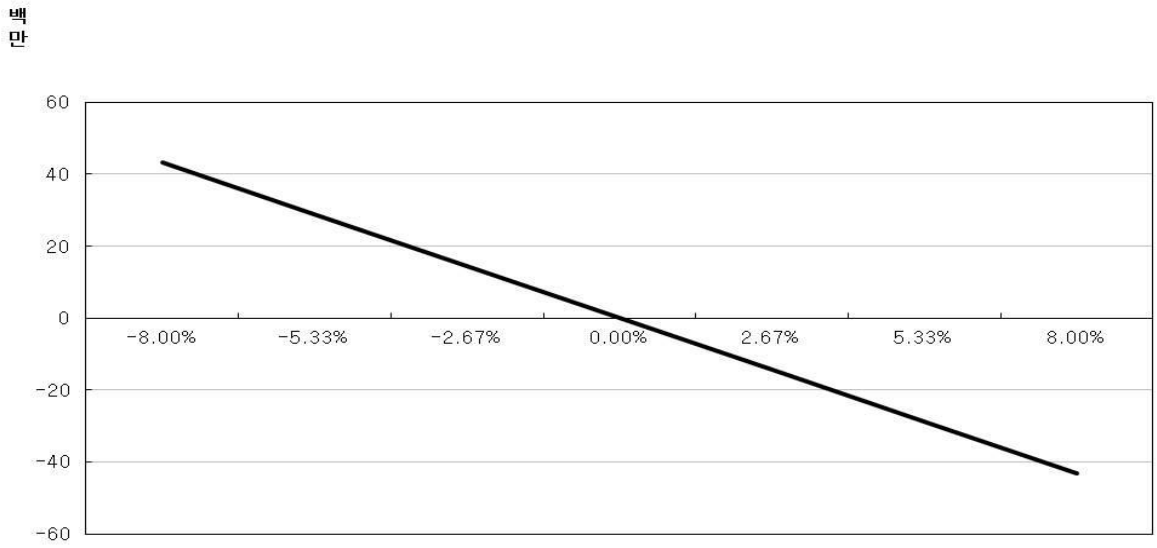
공시일: 2020-07-21

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	3,085	0	3,085	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	1,189	-1,189	장내
합계			3,085	1,189	1,896	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	21

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	352

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

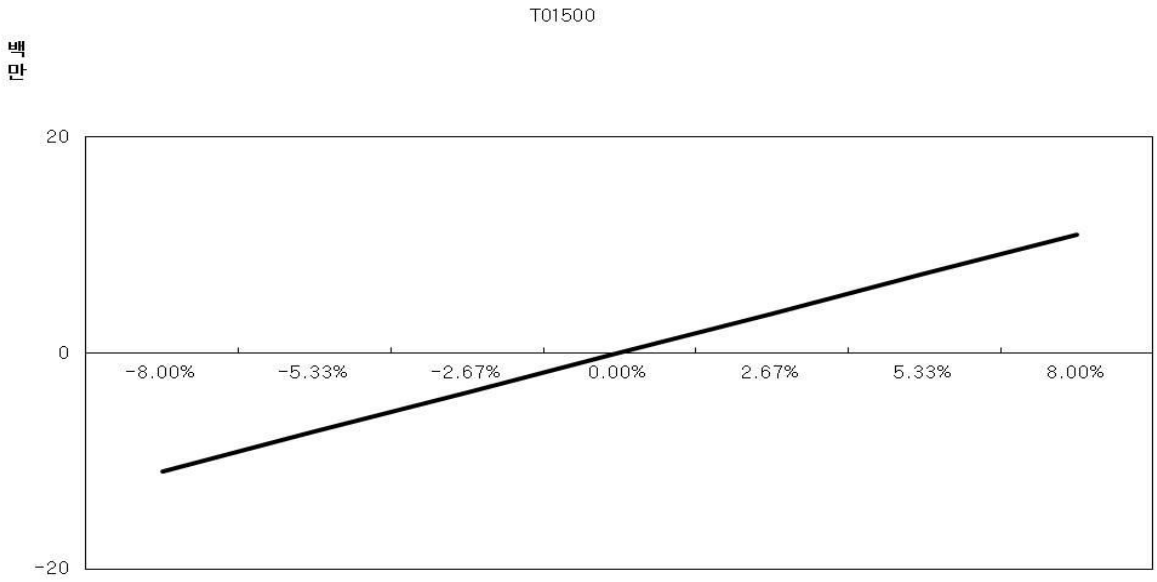
공시일: 2020-07-21

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	542	0	542	장내
신규	주가지수	스왑	42	17	25	장외
누계	주가지수	스왑	52,463	4,179	48,284	장외
합계			53,005	4,179	48,826	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,091