

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-09-03

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 | 1,012 | 0 | 1,012 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 2 | 4 | -2 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 7,865 | 0 | 7,865 | 장내 |
| 합계 | | | 8,877 | 0 | 8,877 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,153

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

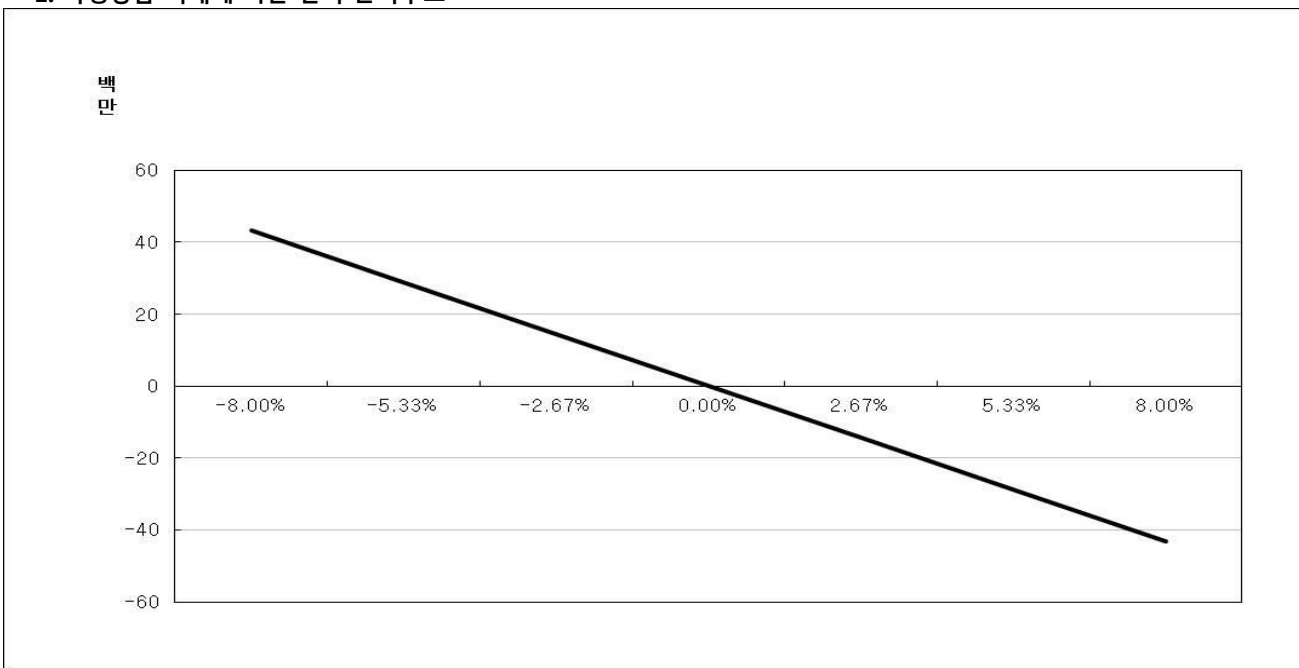
공시일: 2020-09-03

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 | 3,634 | 0 | 3,634 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 1,262 | -1,262 | 장내 |
| 합계 | | | 3,634 | 1,262 | 2,372 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

363

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-09-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 11 | -11 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 610 | 0 | 610 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 48 | 131 | -83 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 72,614 | 4,328 | 68,286 | 장외 |
| 합계 | | | 73,223 | 4,328 | 68,895 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,903