

## 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2020-12-16

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 0      | 93    | -93       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 556    | 0     | 556       | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 9,529  | 0     | 9,529     | 장내 |
| 합계 |      |      | 10,085 | 0     | 10,085    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

44

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,391

## 펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

공시일: 2020-12-16

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | 주식   | 27    | 27    | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 3,721 | 0     | 3,721     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 48    | 97    | -49       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 1,402 | -1,402    | 장내 |
| 합계 |      |      | 3,721 | 1,402 | 2,319     |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

백만



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

342

## 펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

공시일: 2020-12-16

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | 주식   | 60     | 0     | 60        | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 681    | 0     | 681       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 59    | -59       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0      | 59    | -59       | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 12     | 116   | -104      | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 69,542 | 4,185 | 65,357    | 장외 |
| 합계 |      |      | 70,223 | 4,245 | 65,978    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,795