

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

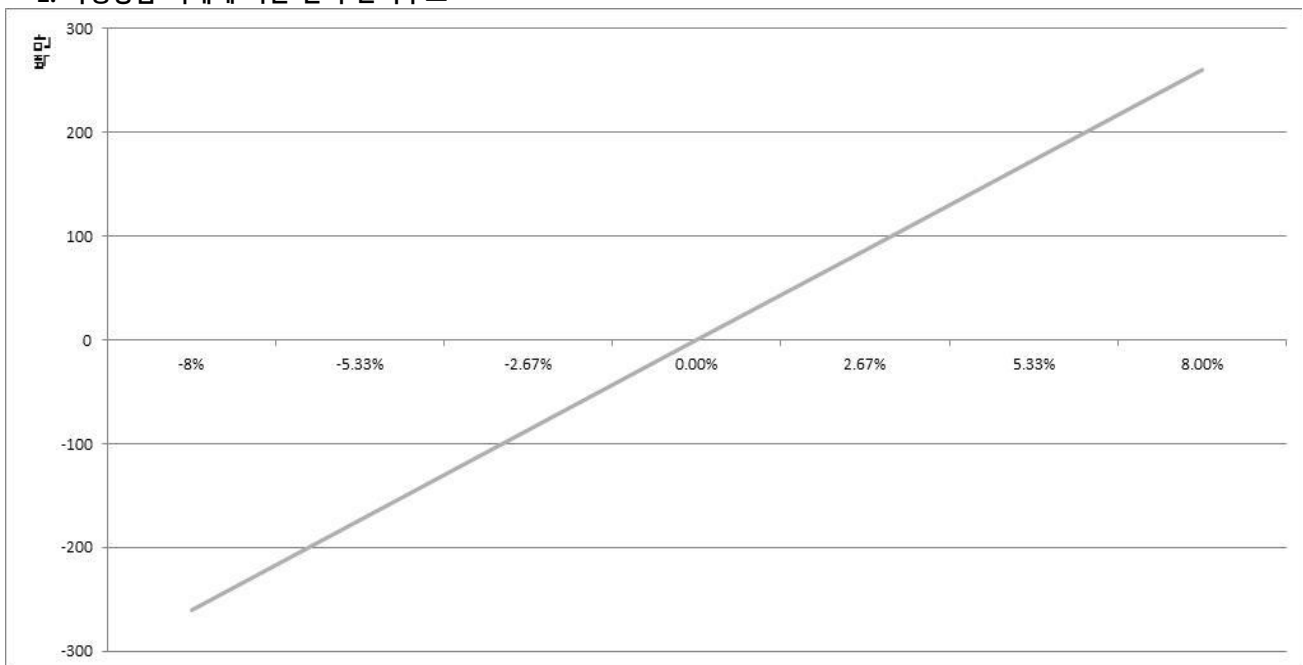
공시일: 2021-05-13

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	3,269	0	3,269	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,206	0	11,206	장내
합계			14,476	0	14,476	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

261

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,357

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

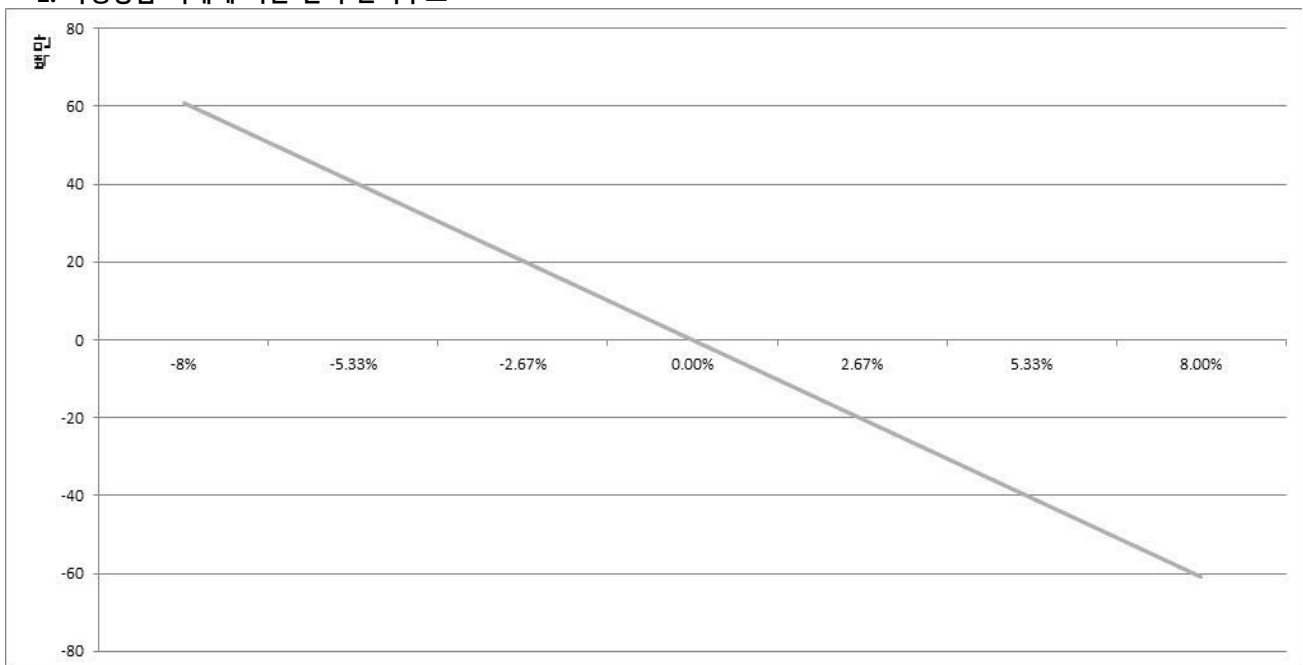
공시일: 2021-05-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	450	-450	장내
누계	주가지수	선물	0	764	-764	장내
신규	주식	주식	439	0	439	장내
누계	주식	주식	760	0	760	장내
합계			760	764	-4	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

61

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

52

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

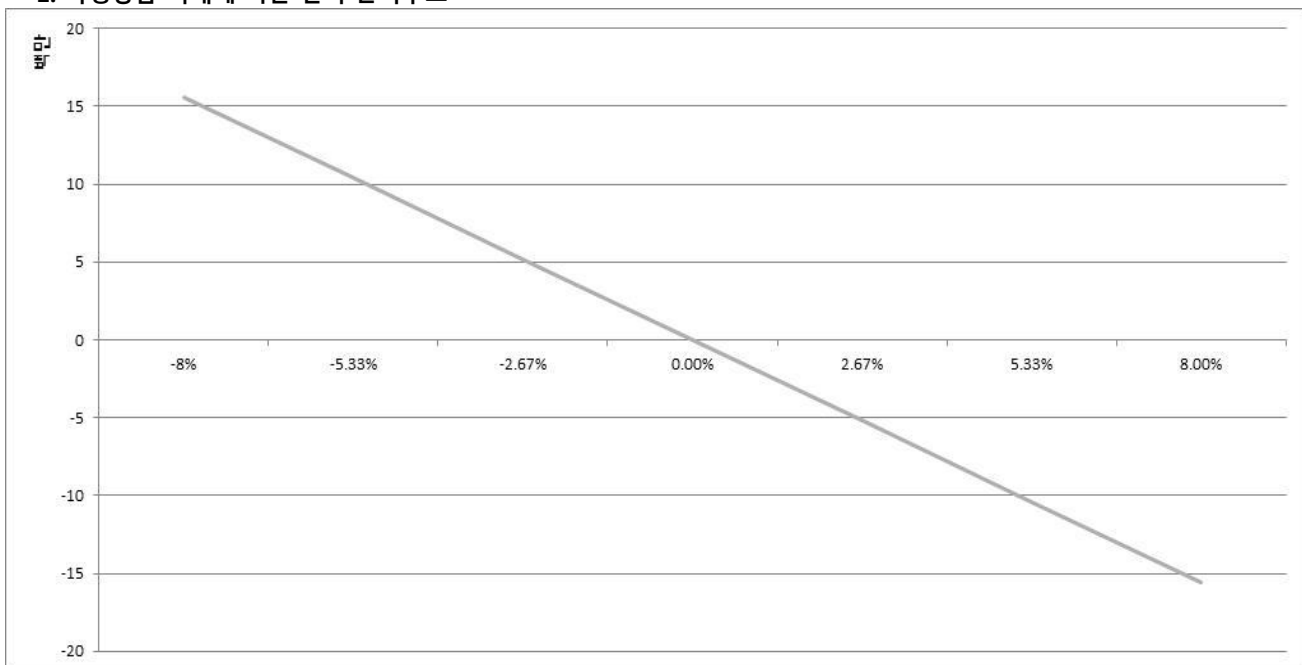
공시일: 2021-05-13

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	61	25	36	장내
누계	주식	주식	4,756	231	4,524	장내
신규	유가증권	선물	950	950	0	장내
누계	유가증권	선물	0	950	-950	장내
합계			4,756	1,181	3,574	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

372

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

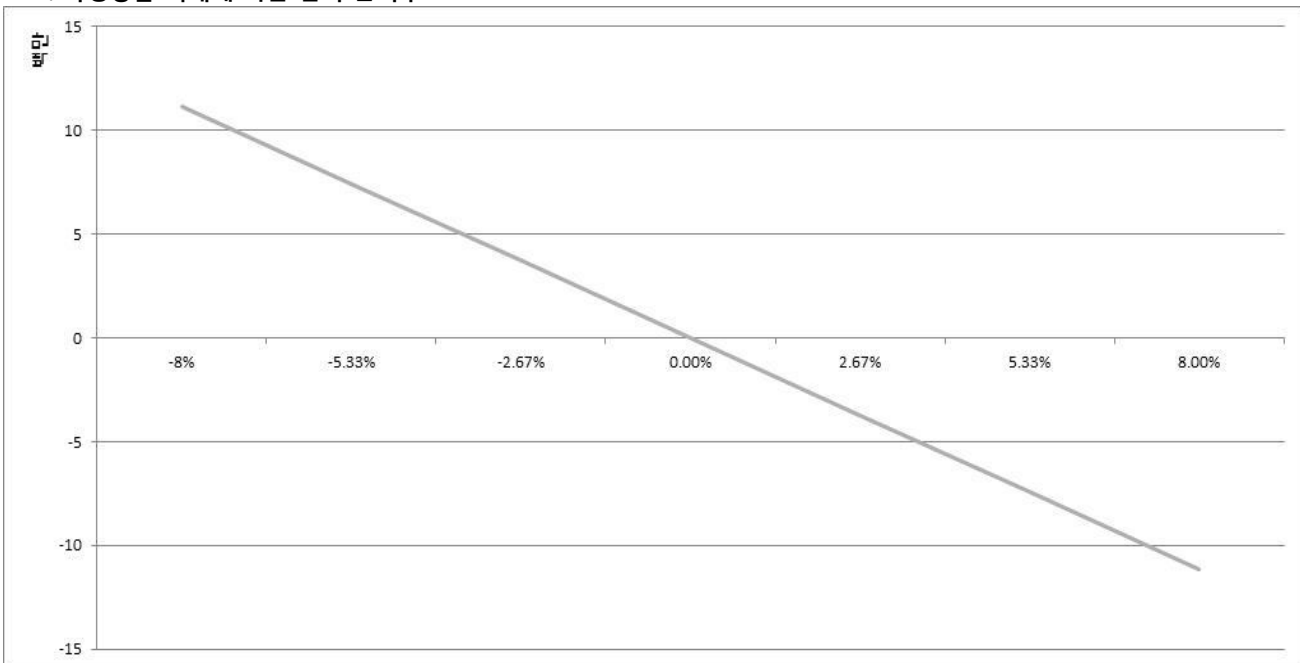
공시일: 2021-05-13

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	563	0	563	장내
신규	유가증권	선물	40	40	0	장내
누계	유가증권	선물	0	40	-40	장내
신규	주가지수	스왑	0	182	-182	장외
누계	주가지수	스왑	1,498	1,386	112	장외
합계			2,062	1,427	635	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

113