

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

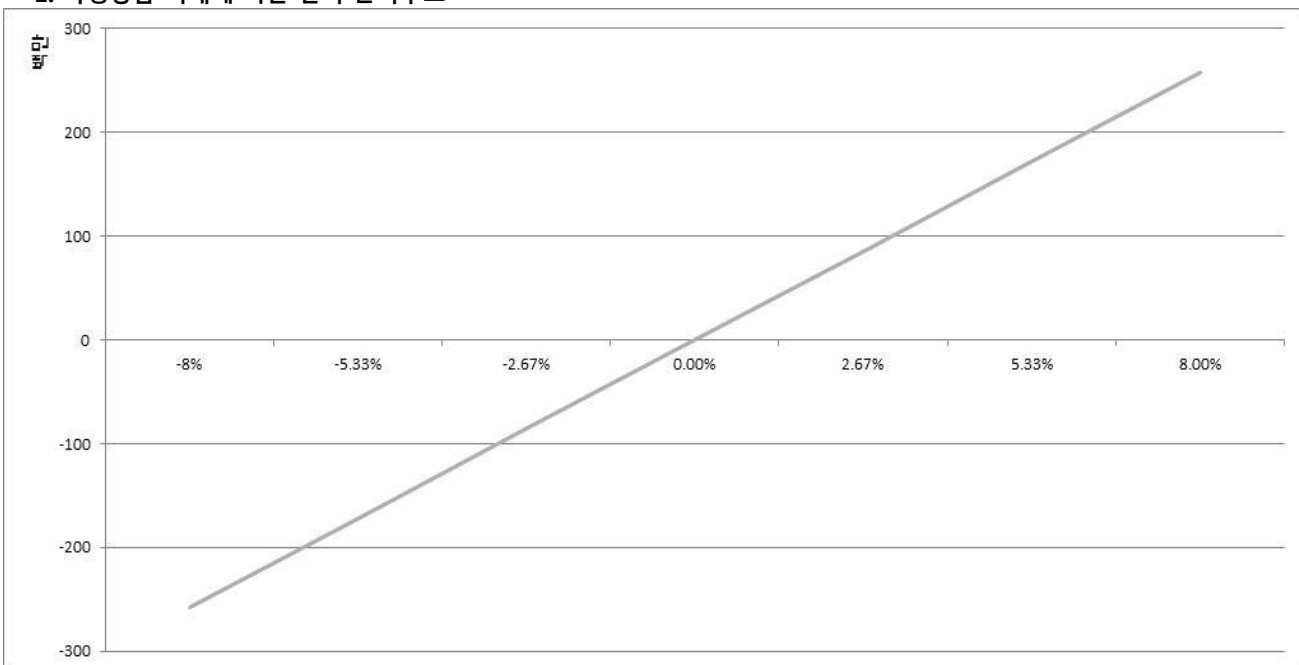
공시일: 2021-05-14

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	3,225	0	3,225	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,056	0	11,056	장내
합계			14,280	0	14,280	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

257

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,336

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

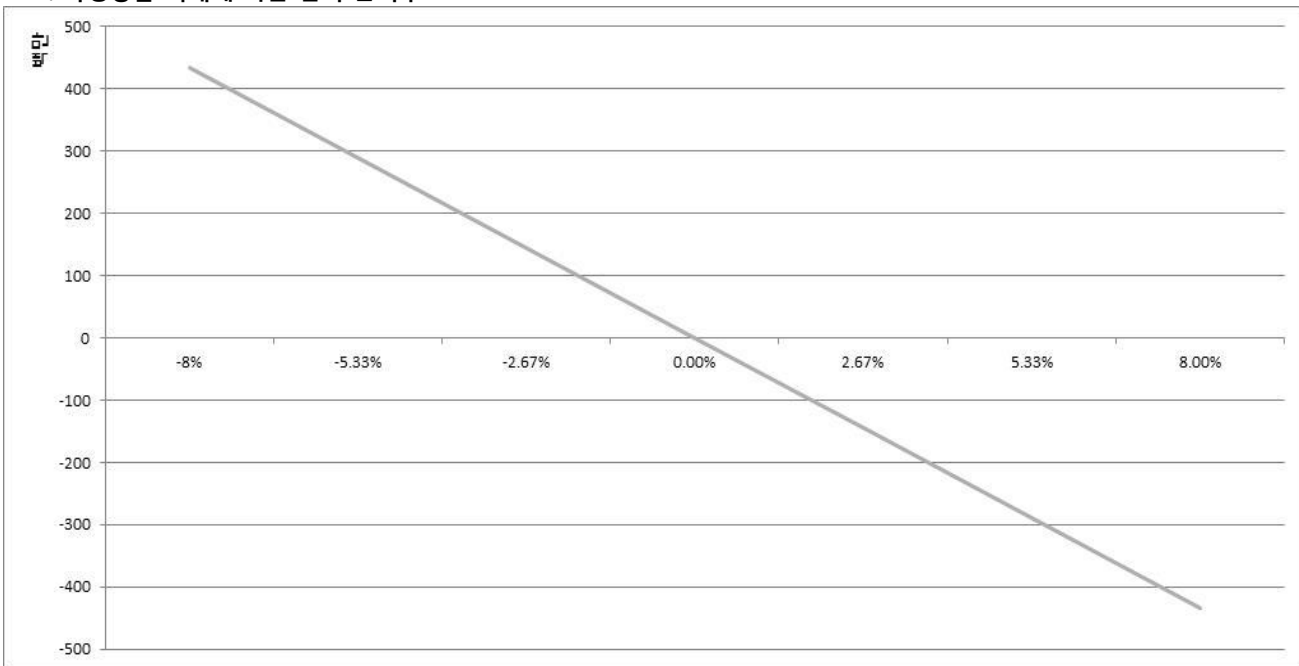
공시일: 2021-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	4,692	-4,692	장내
누계	주가지수	선물	0	5,444	-5,444	장내
신규	주식	주식	4,723	5	4,719	장내
누계	주식	주식	5,468	0	5,468	장내
합계			5,468	5,444	23	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

434

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

373

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

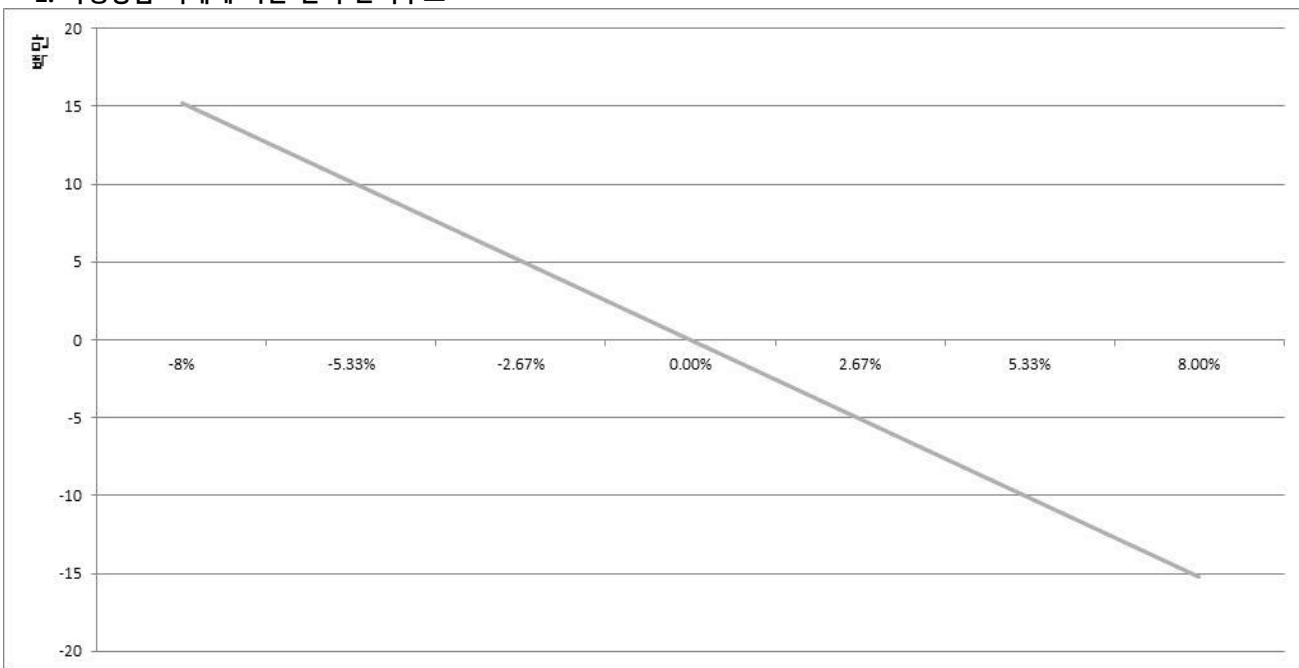
공시일: 2021-05-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	159	106	53	장내
누계	주식	주식	4,764	229	4,535	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	937	-937	장내
합계			4,764	1,166	3,598	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

276

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

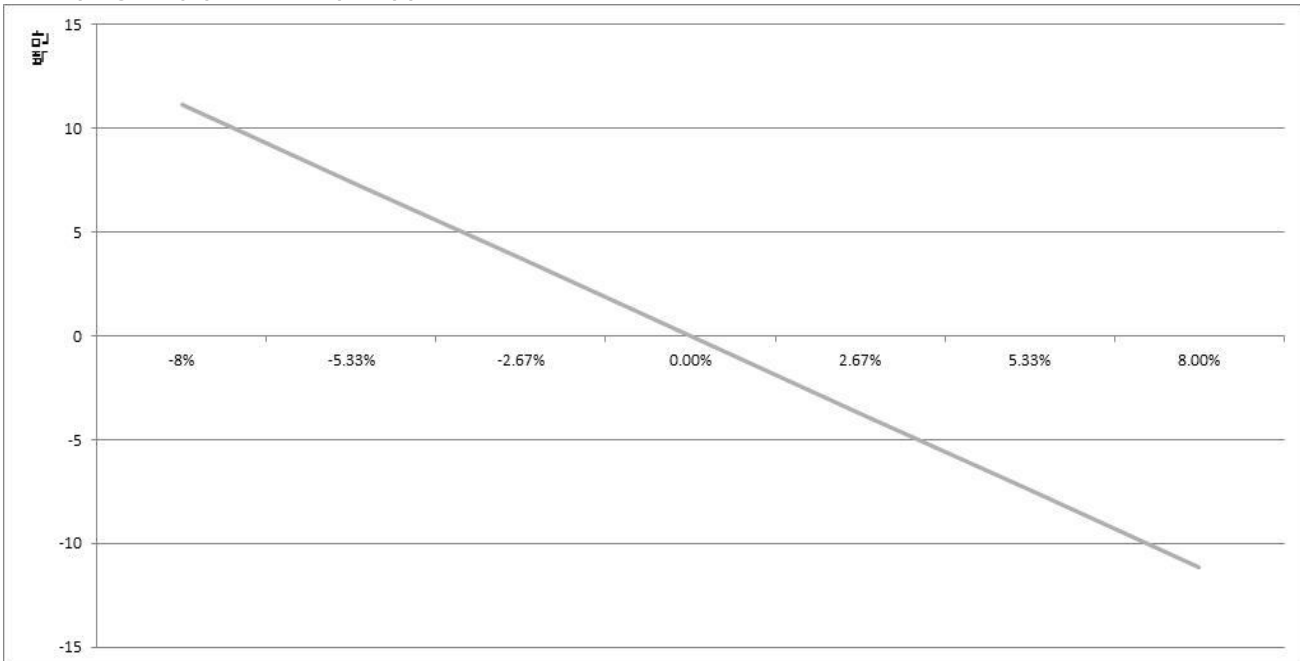
공시일: 2021-05-14

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	555	0	555	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	40	-40	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	1,458	1,365	94	장외
합계			2,013	1,405	609	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

109