

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

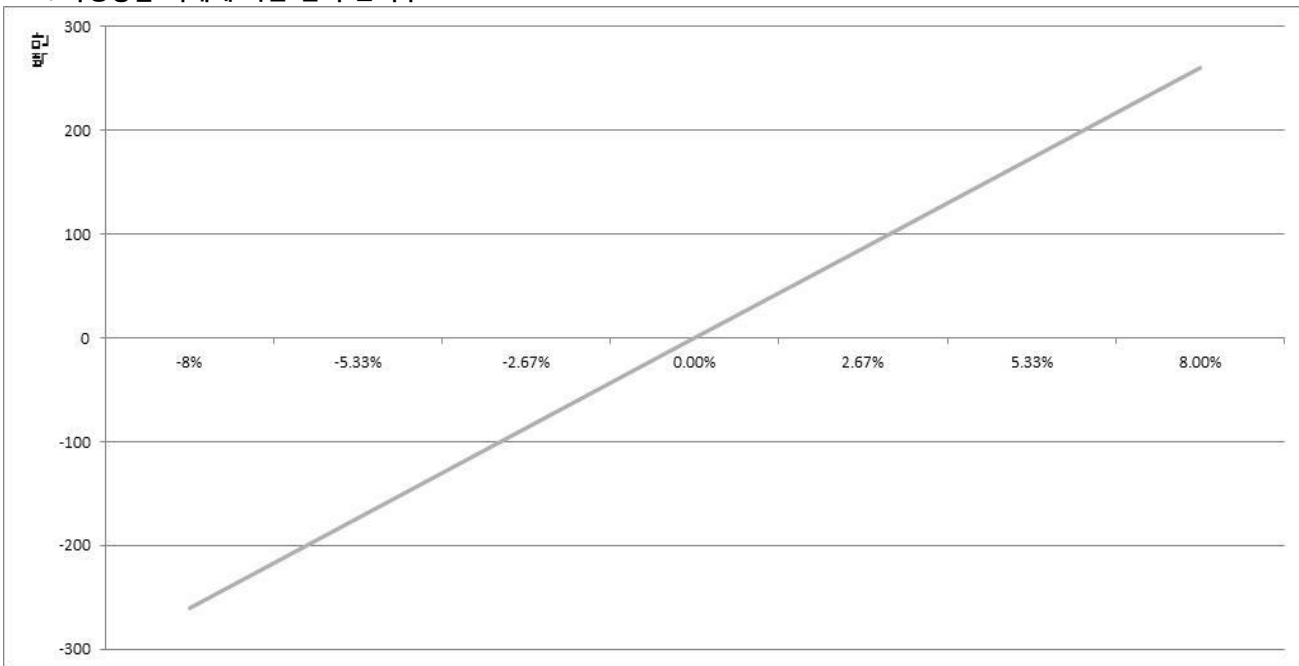
공시일: 2021-05-17

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	3,256	0	3,256	장내
신규	주식	주식	0	11	-11	장내
누계	주식	주식	11,151	0	11,151	장내
합계			14,407	0	14,407	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

260

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,347

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

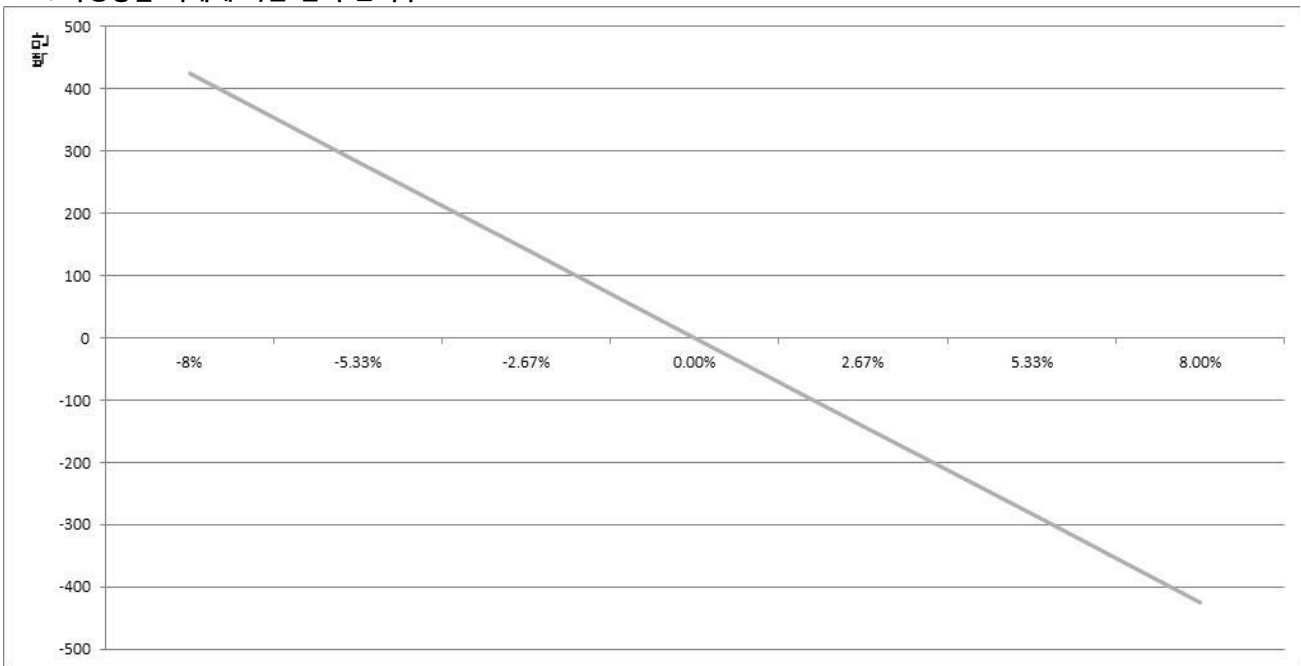
공시일: 2021-05-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	247	0	247	장내
누계	주가지수	선물	0	5,319	-5,319	장내
신규	주식	주식	110	360	-249	장내
누계	주식	주식	5,334	0	5,334	장내
합계			5,334	5,319	15	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

424

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

366

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

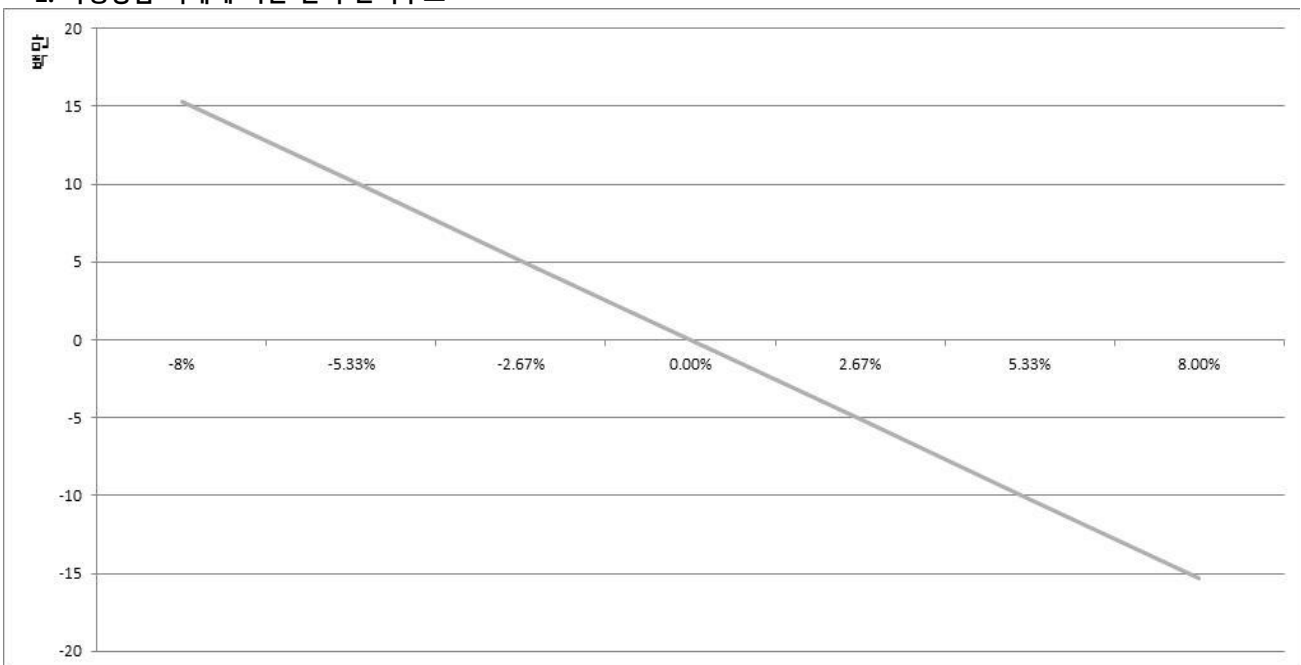
공시일: 2021-05-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	75	0	75	장내
누계	주식	주식	4,838	229	4,609	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	938	-938	장내
합계			4,838	1,168	3,670	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

282

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

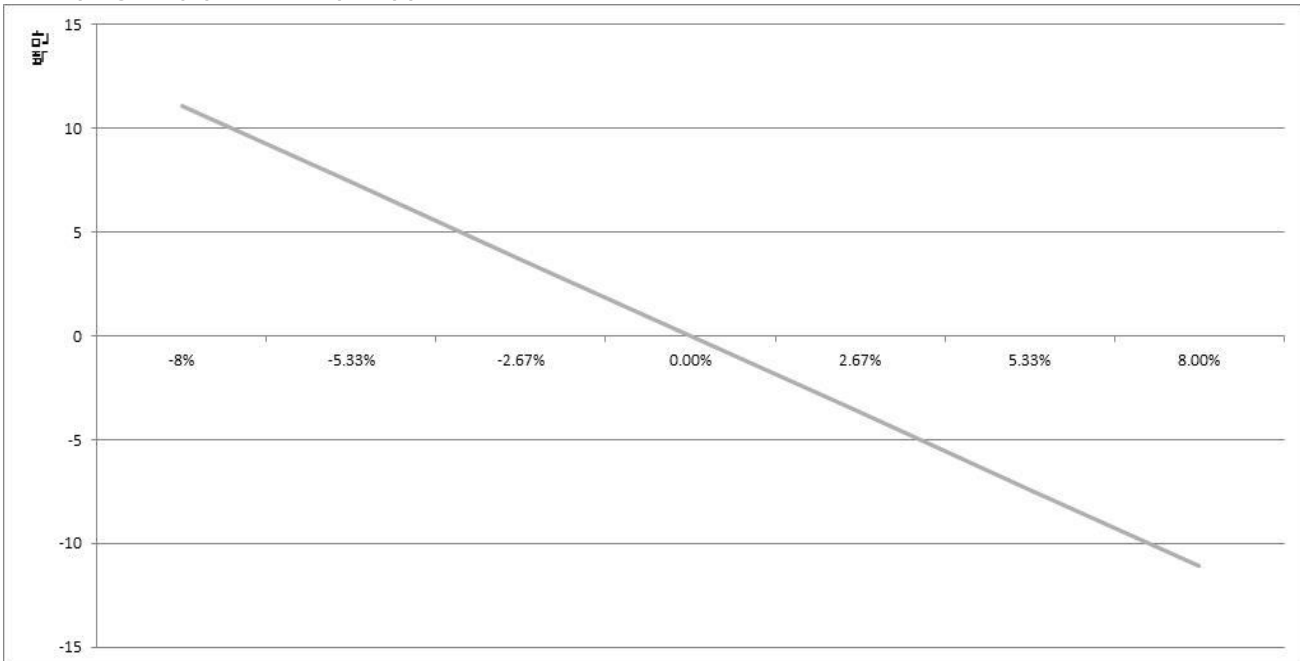
공시일: 2021-05-17

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	51	0	51	장내
누계	주식	주식	599	0	599	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	1,470	1,387	84	장외
합계			2,069	1,427	642	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

113