

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

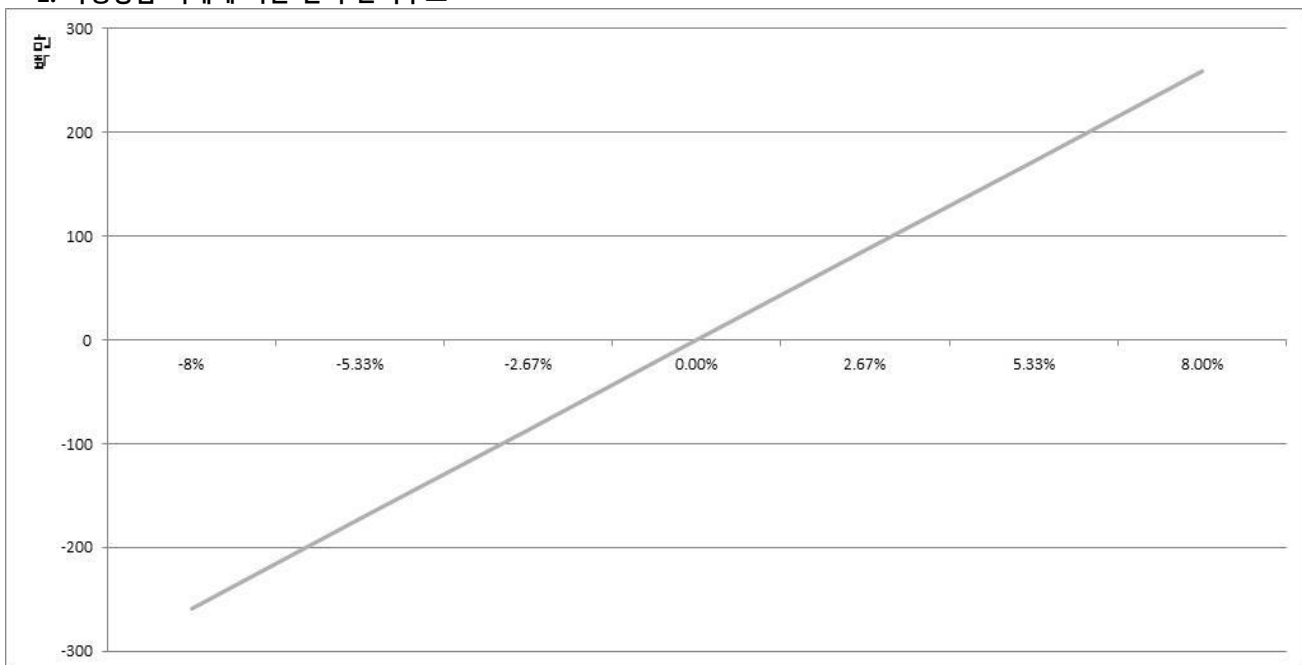
공시일: 2021-05-18

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	3,242	0	3,242	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,118	0	11,118	장내
합계			14,359	0	14,359	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

259

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,342

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

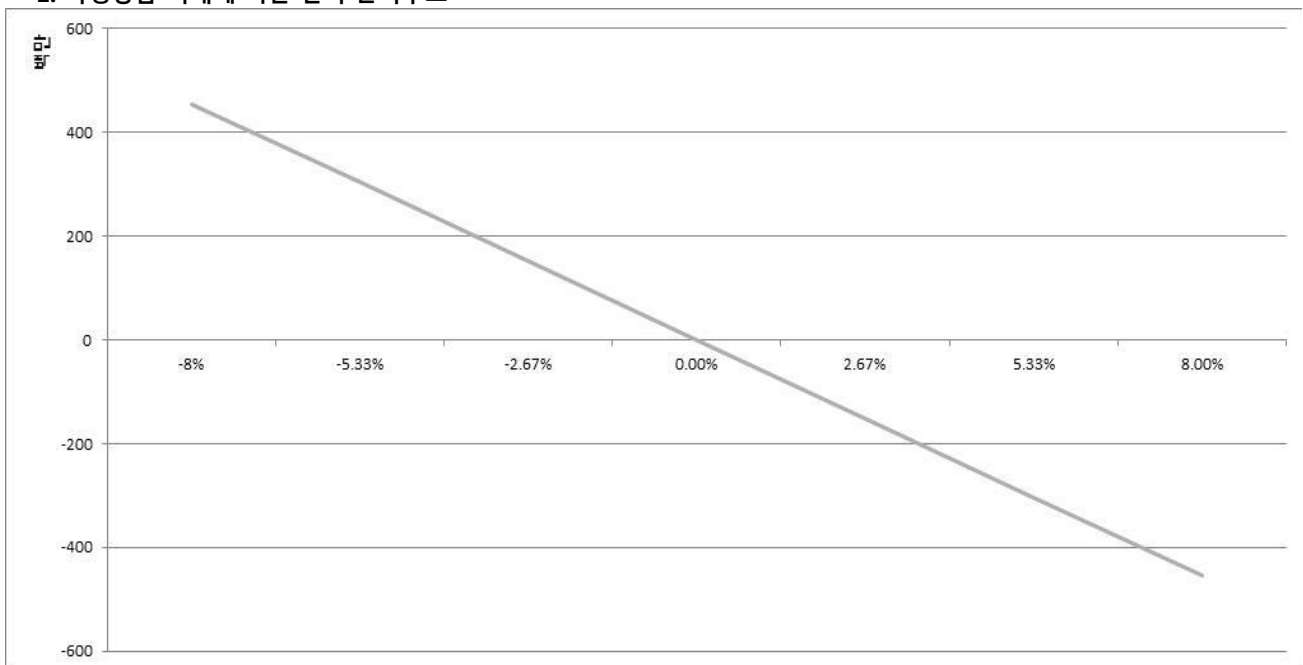
공시일: 2021-05-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	385	-385	장내
누계	주가지수	선물	0	5,703	-5,703	장내
신규	주식	주식	491	62	428	장내
누계	주식	주식	5,755	0	5,755	장내
합계			5,755	5,703	52	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

455

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

380

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

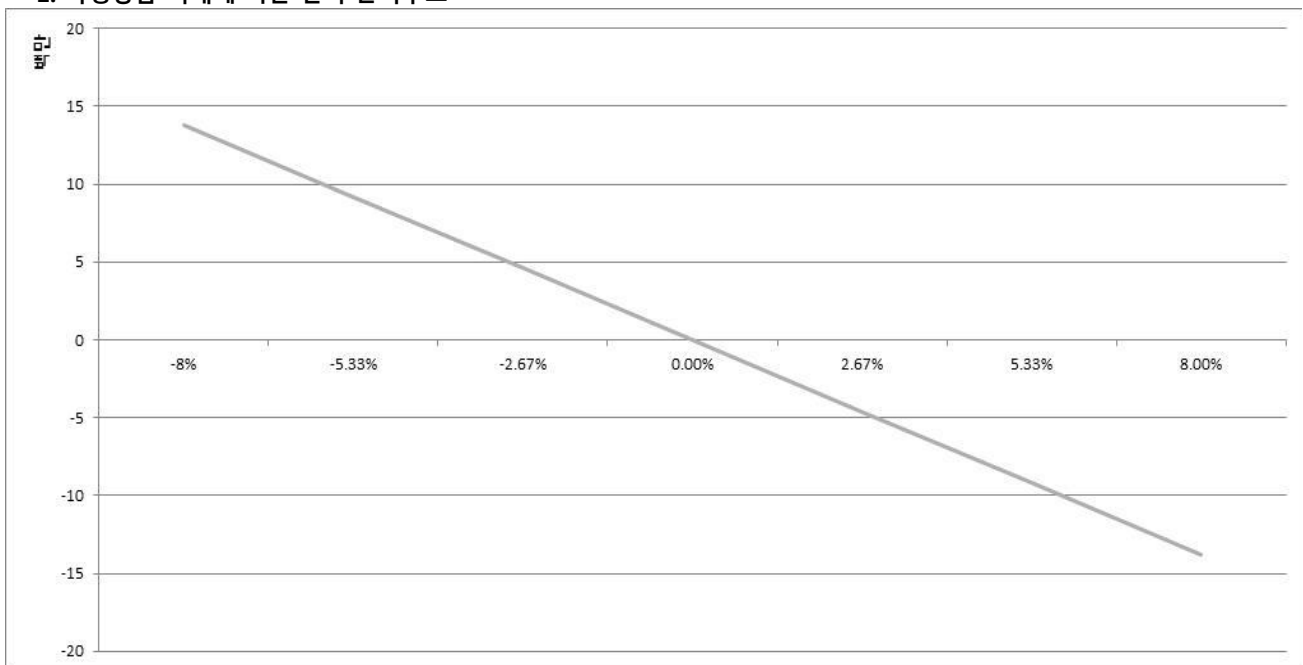
공시일: 2021-05-18

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	13	512	-499	장내
누계	주식	주식	4,635	552	4,084	장내
신규	유가증권	선물	295	0	295	장내
누계	유가증권	선물	0	653	-653	장내
합계			4,635	1,205	3,431	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

258

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

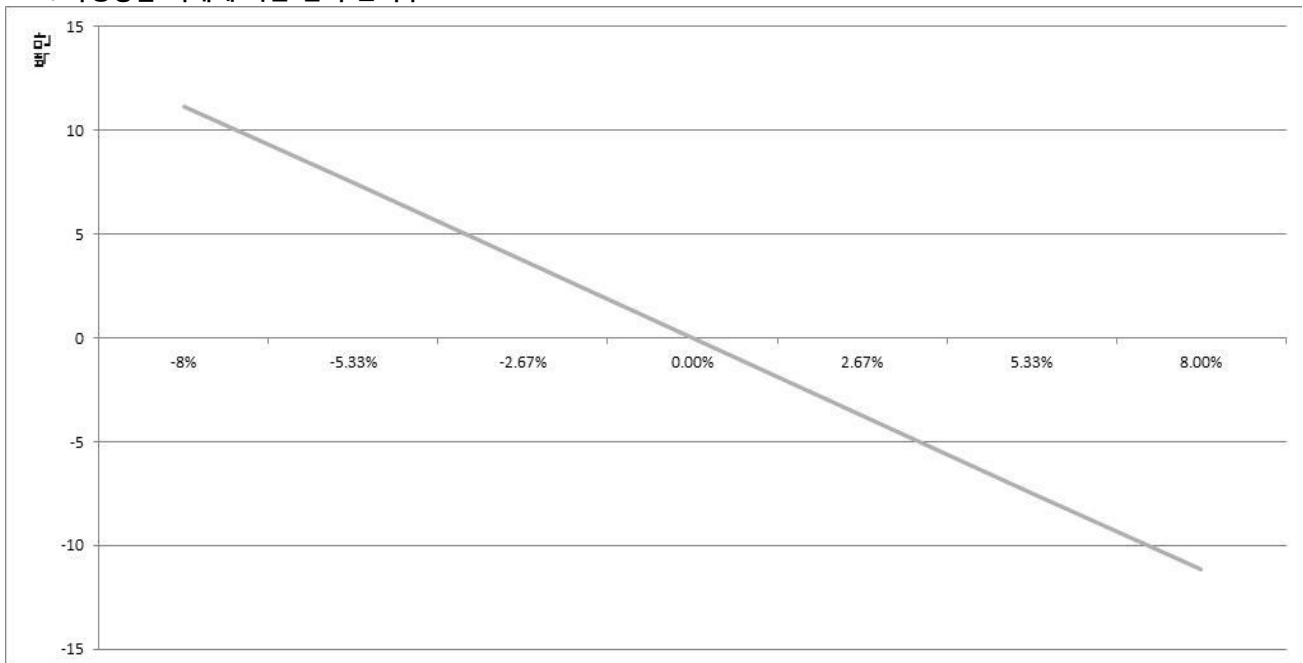
공시일: 2021-05-18

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	593	0	593	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	39	-39	장내
신규	주가지수	스왑	0	2	-2	장외
누계	주가지수	스왑	1,482	1,392	90	장외
합계			2,075	1,432	643	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

114