

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

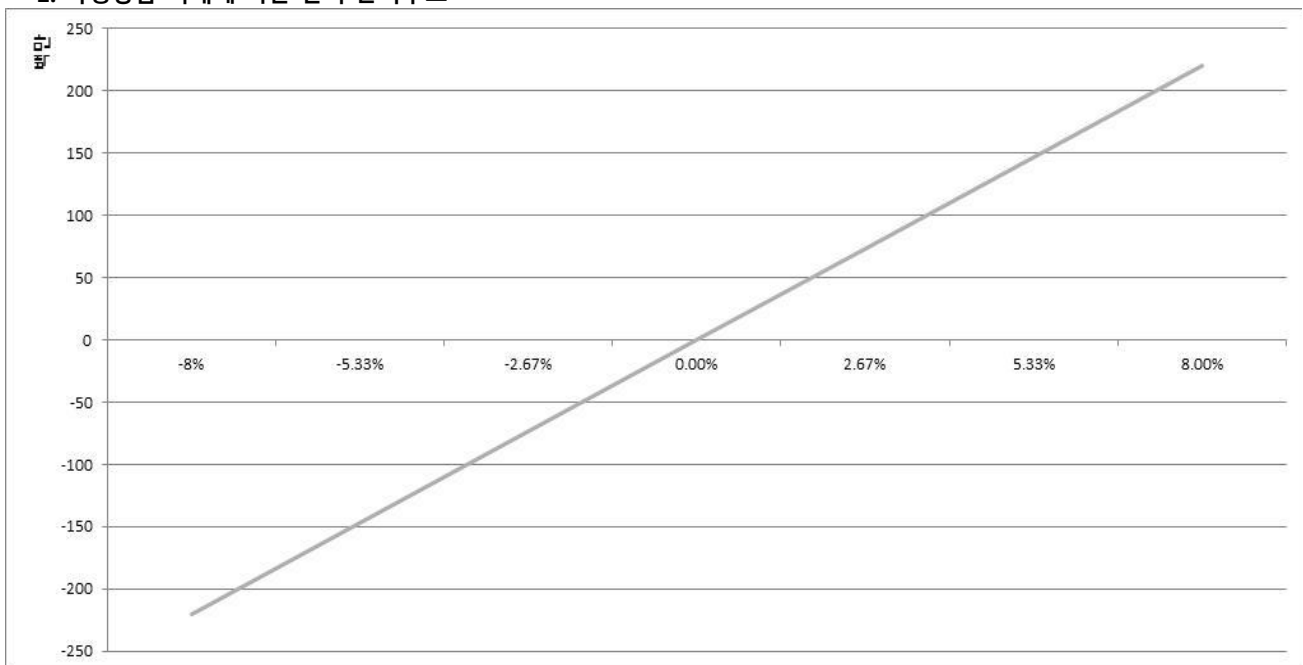
공시일: 2021-05-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	529	-529	장내
누계	주가지수	선물	2,750	0	2,750	장내
신규	주식	주식	539	0	539	장내
누계	주식	주식	11,784	0	11,784	장내
합계			14,535	0	14,535	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

220

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,337

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

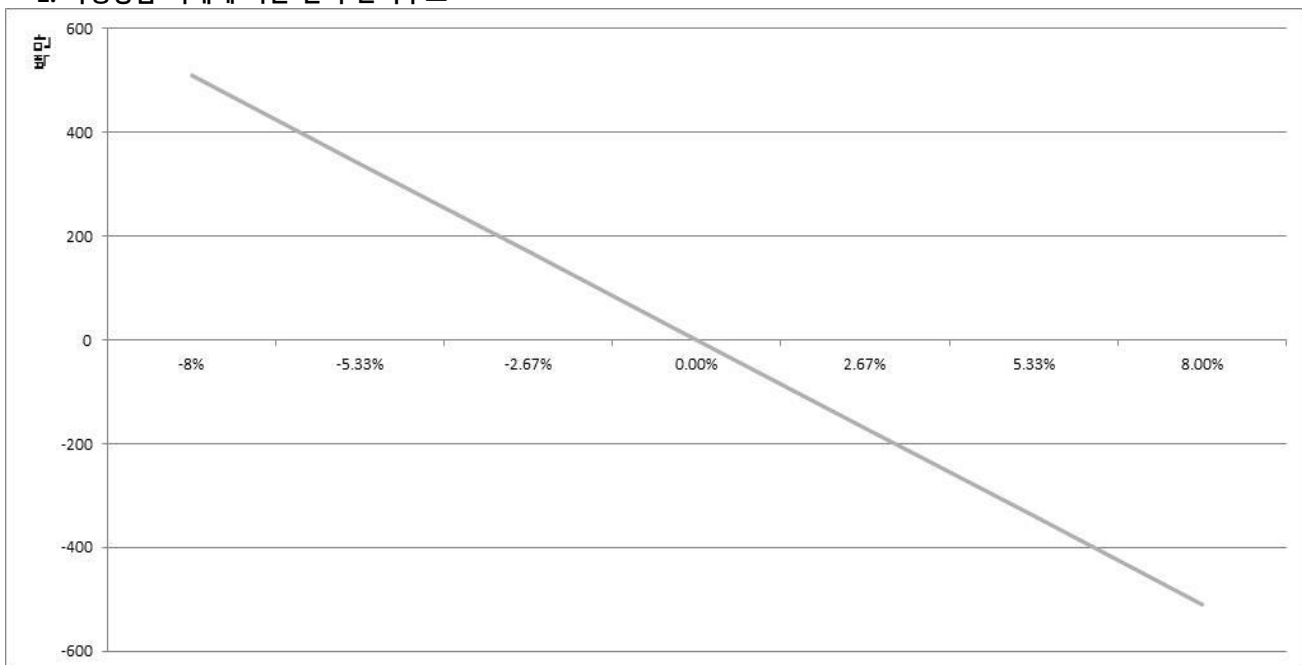
공시일: 2021-05-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	612	-612	장내
누계	주가지수	선물	0	6,383	-6,383	장내
신규	주식	주식	613	0	613	장내
누계	주식	주식	6,429	0	6,429	장내
합계			6,429	6,383	46	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

509

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

429

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

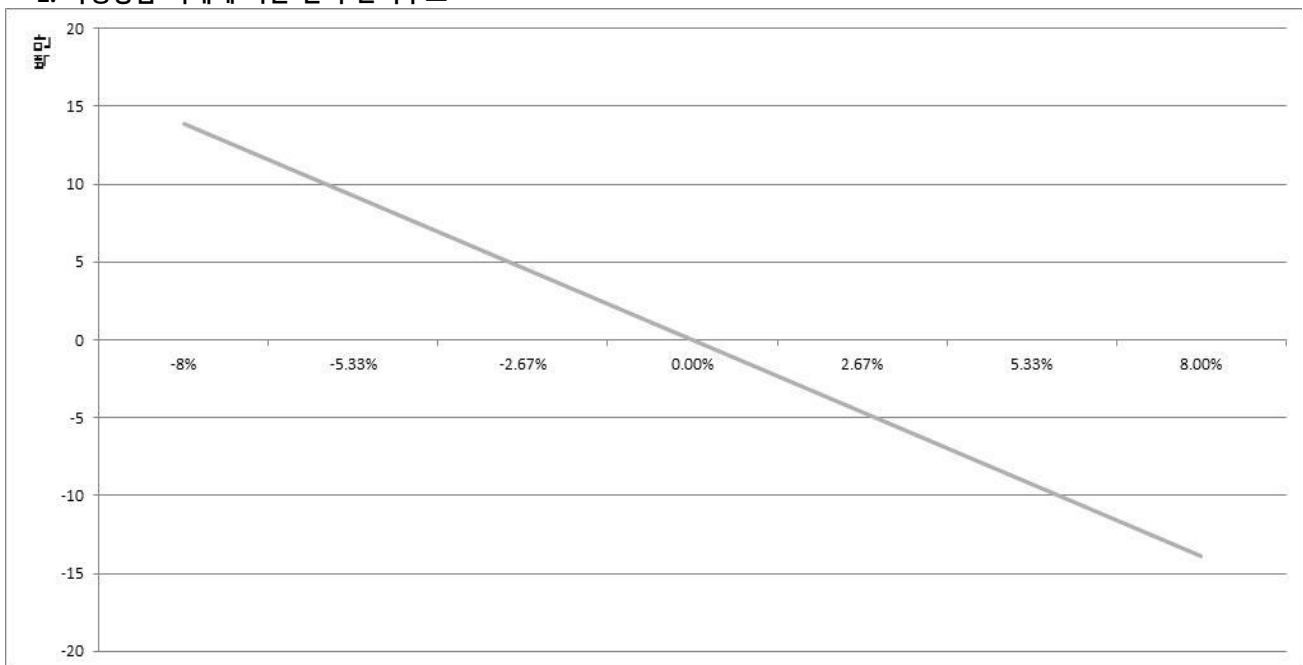
공시일: 2021-05-20

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	64	-64	장내
누계	주식	주식	4,634	584	4,050	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	664	-664	장내
합계			4,634	1,248	3,386	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

255

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

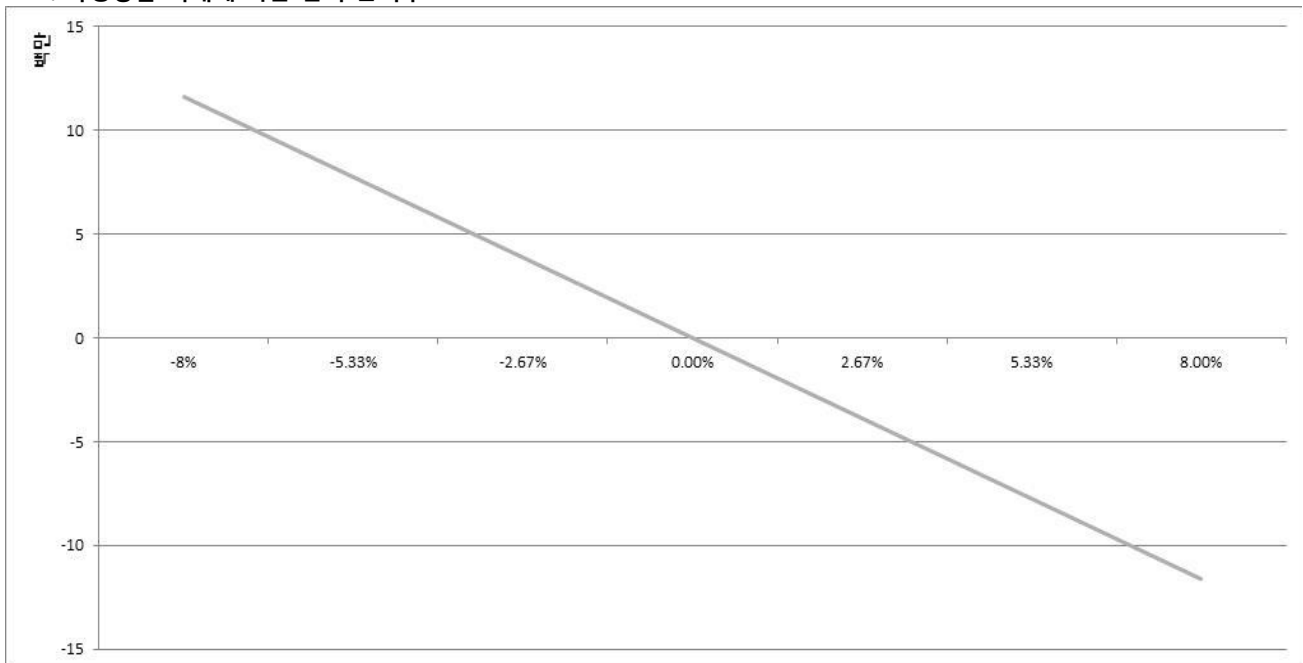
공시일: 2021-05-20

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	606	0	606	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	1,508	1,415	93	장외
합계			2,114	1,455	659	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

114