

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

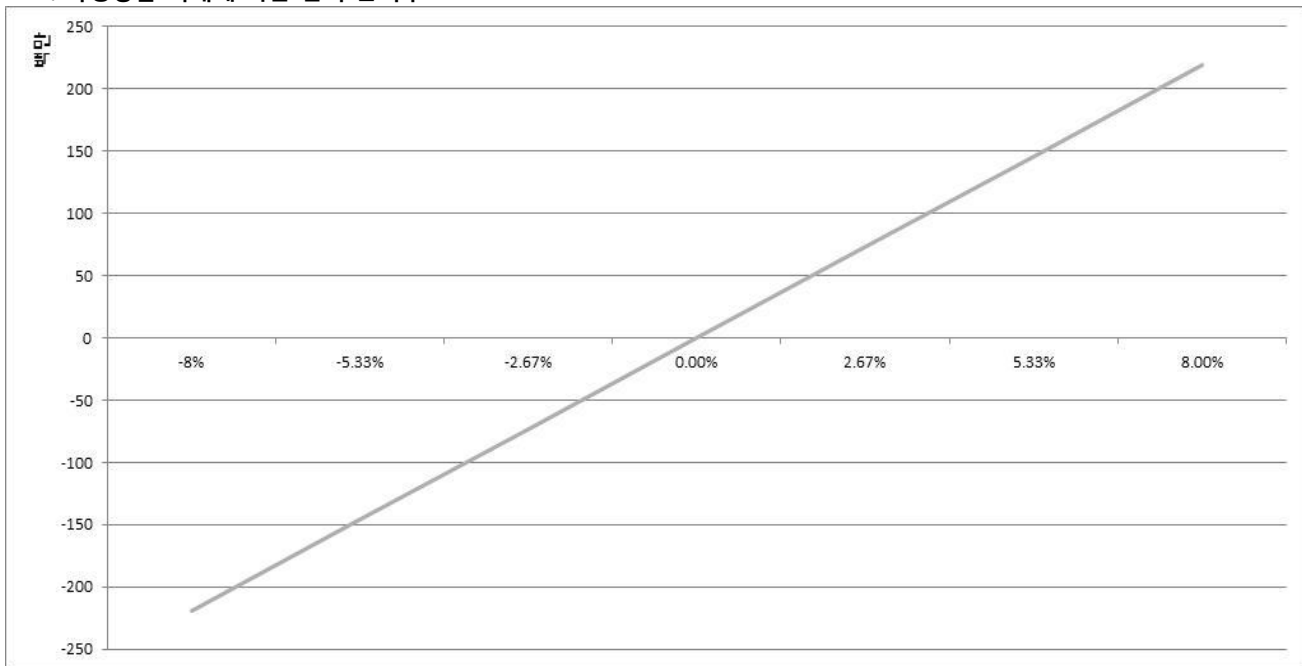
공시일: 2021-05-21

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	2,741	0	2,741	장내
신규	주식	주식	0	2	-2	장내
누계	주식	주식	11,746	0	11,746	장내
합계			14,487	0	14,487	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

219

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,342

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

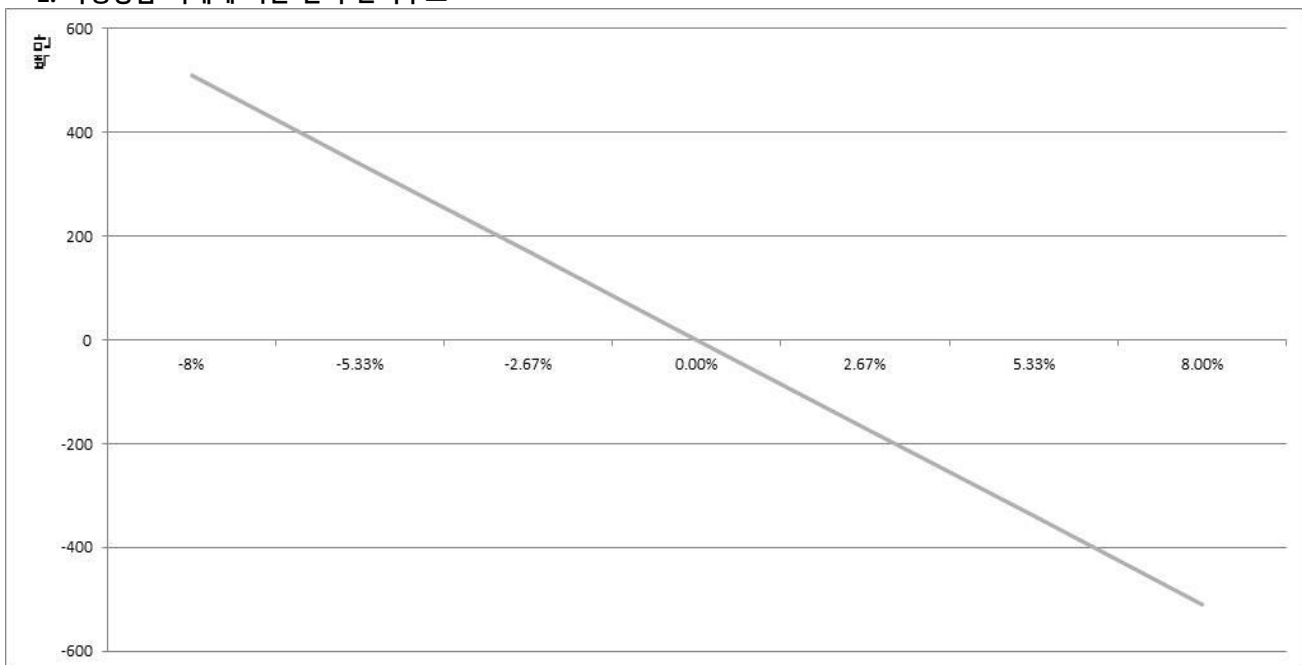
공시일: 2021-05-21

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	0	6,386	-6,386	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	6,400	0	6,400	장내
합계			6,400	6,386	14	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

509

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

387

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

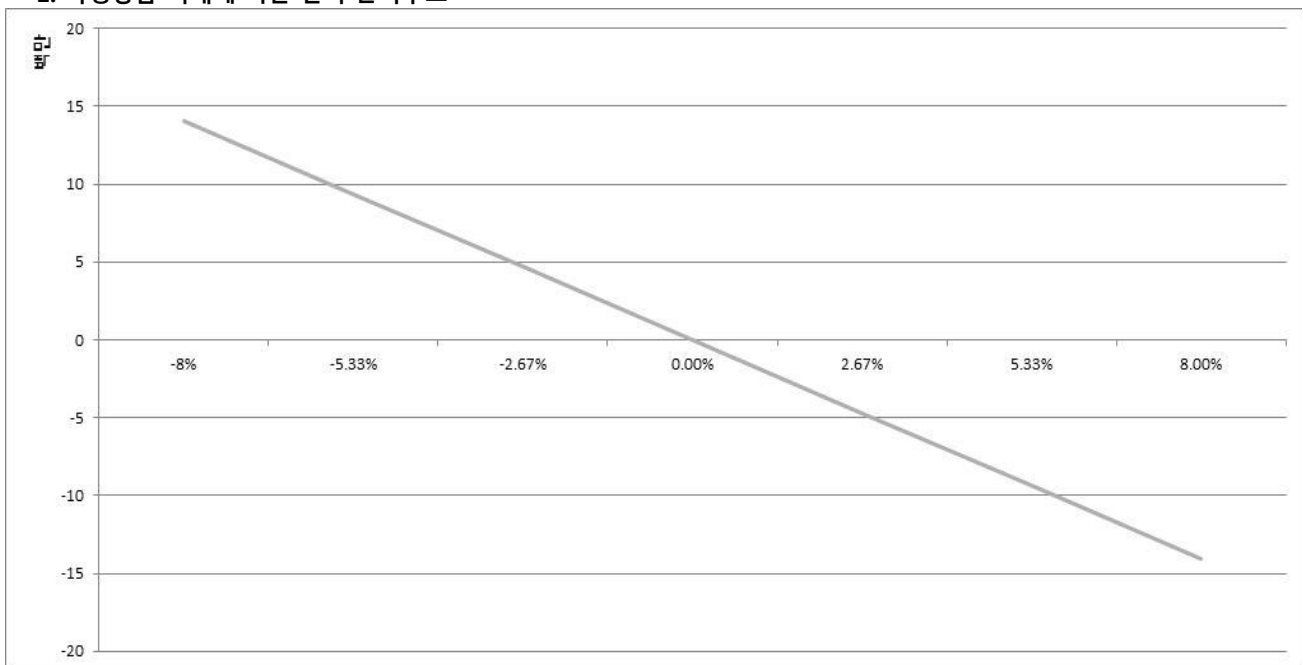
공시일: 2021-05-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	345	175	170	장내
누계	주식	주식	4,799	571	4,228	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	655	-655	장내
합계			4,799	1,226	3,573	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

315

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

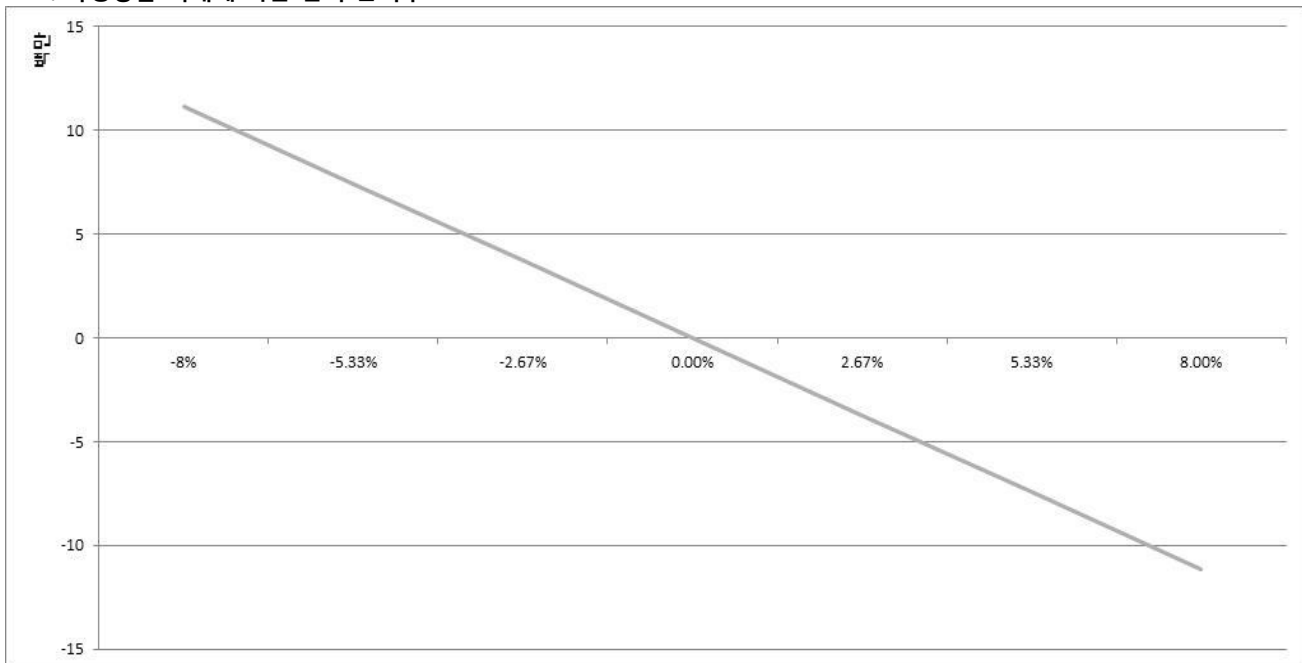
공시일: 2021-05-21

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	602	0	602	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	1,505	1,399	107	장외
합계			2,107	1,439	668	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

117