

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

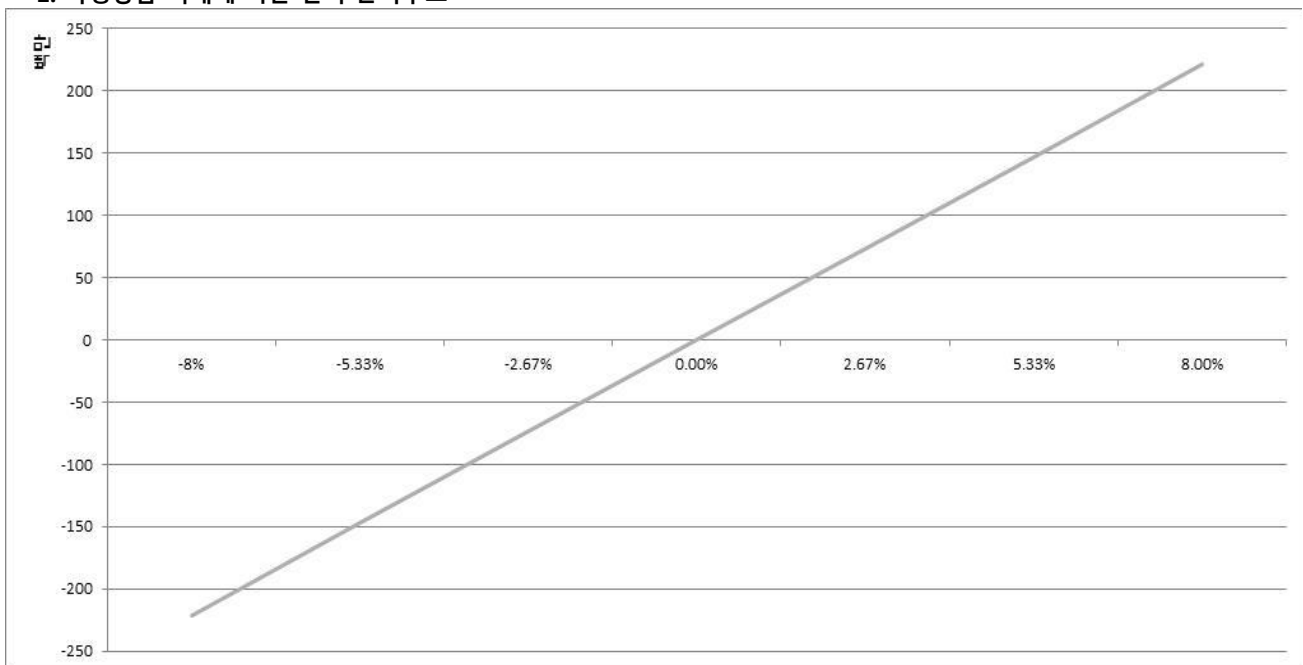
공시일: 2021-05-26

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	2,758	0	2,758	장내
신규	주식	주식	4	0	4	장내
누계	주식	주식	11,827	0	11,827	장내
합계			14,585	0	14,585	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

221

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,351

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

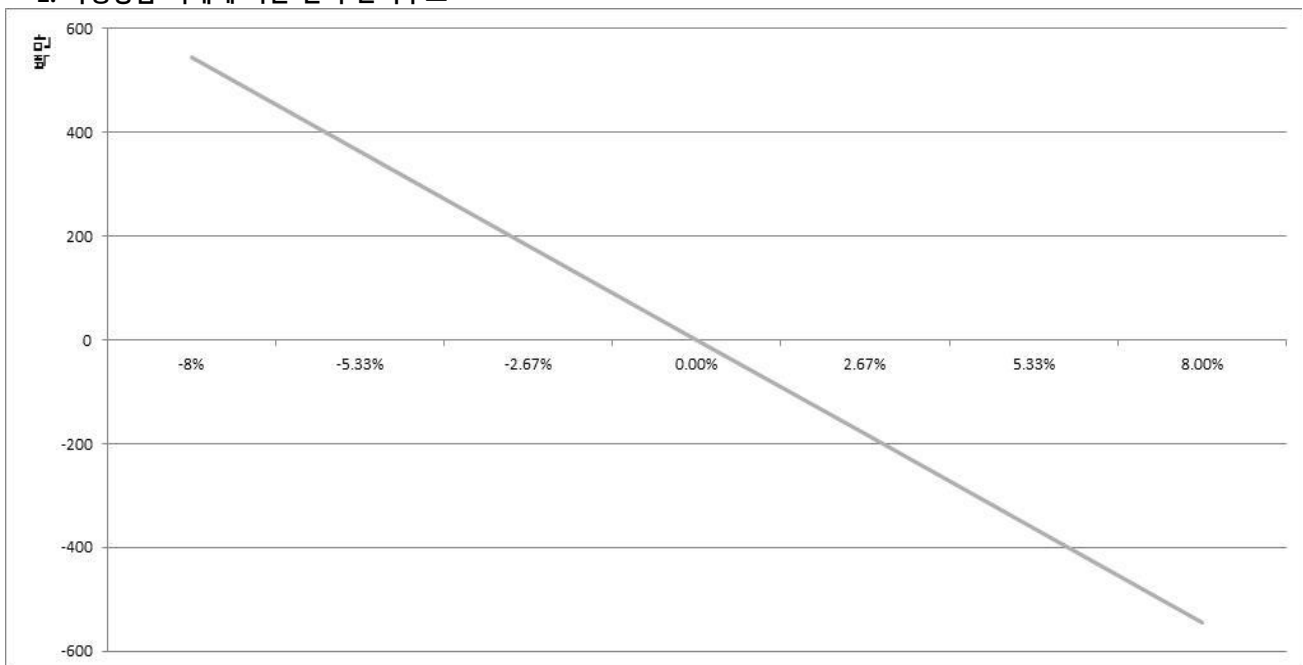
공시일: 2021-05-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	235	-235	장내
누계	주가지수	선물	0	6,804	-6,804	장내
신규	주식	주식	414	0	414	장내
누계	주식	주식	6,940	0	6,940	장내
합계			6,940	6,804	137	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

543

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

419

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

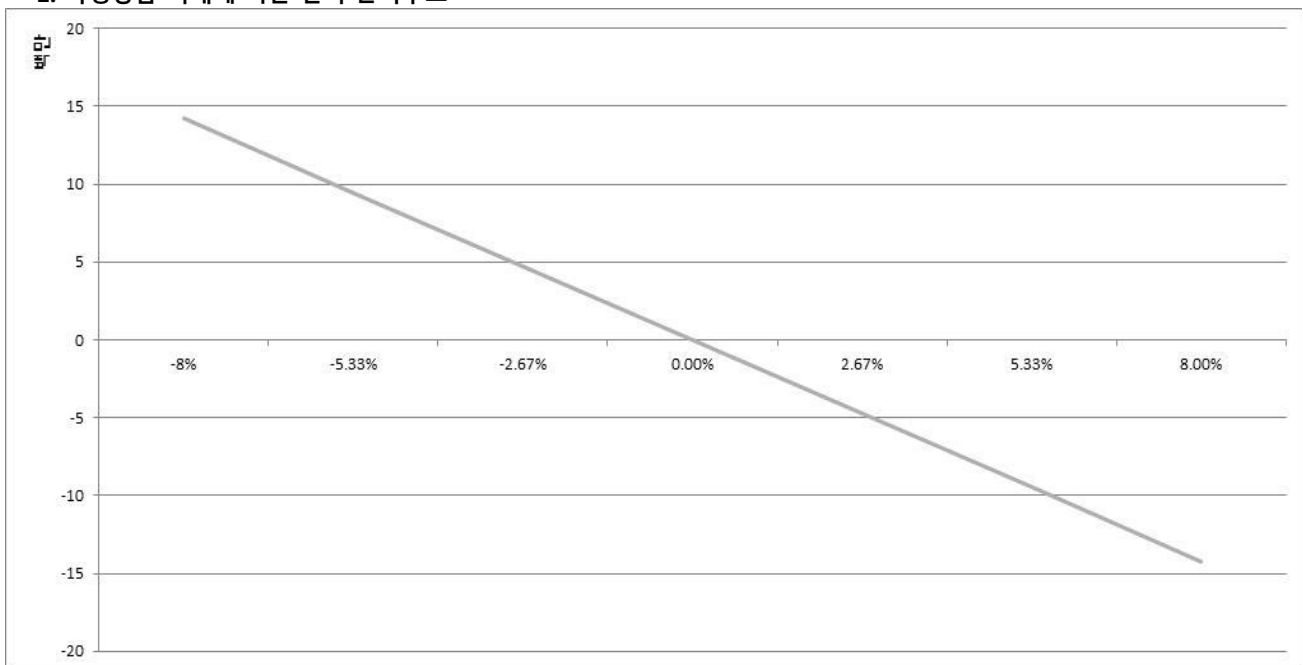
공시일: 2021-05-26

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	84	81	3	장내
누계	주식	주식	4,668	909	3,759	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	661	-661	장내
합계			4,668	1,570	3,098	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

279

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

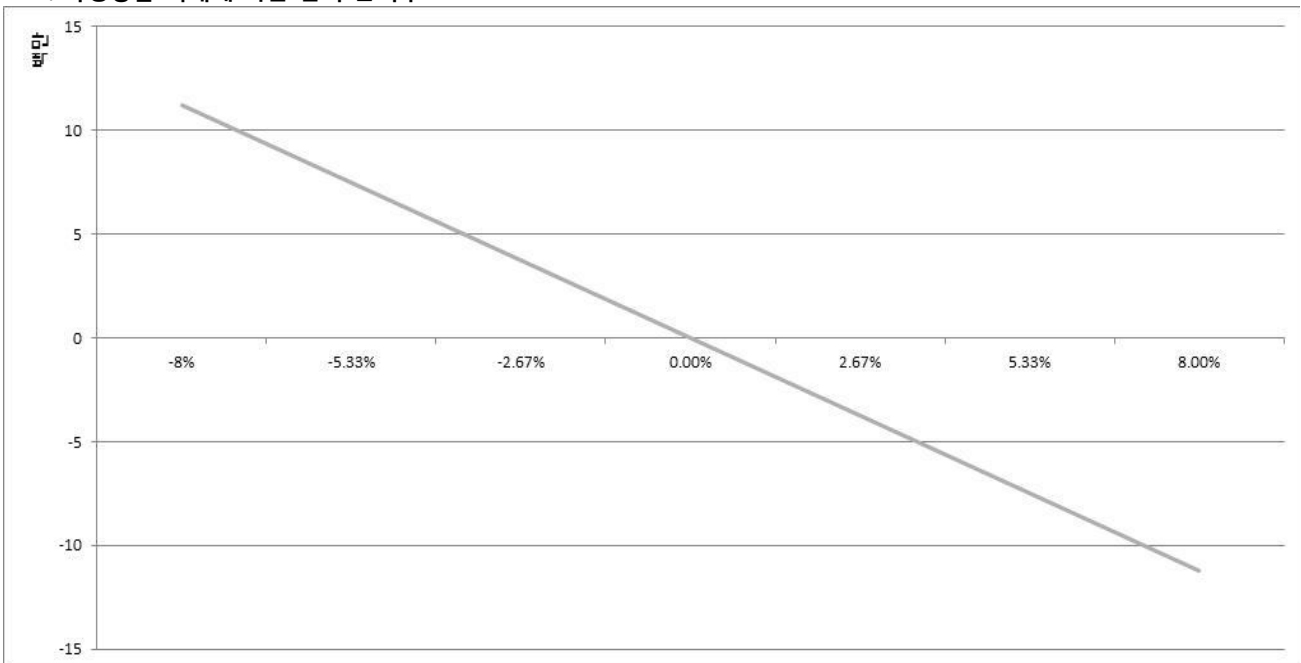
공시일: 2021-05-26

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	601	0	601	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	1,529	1,415	114	장외
합계			2,130	1,455	675	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

121