

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

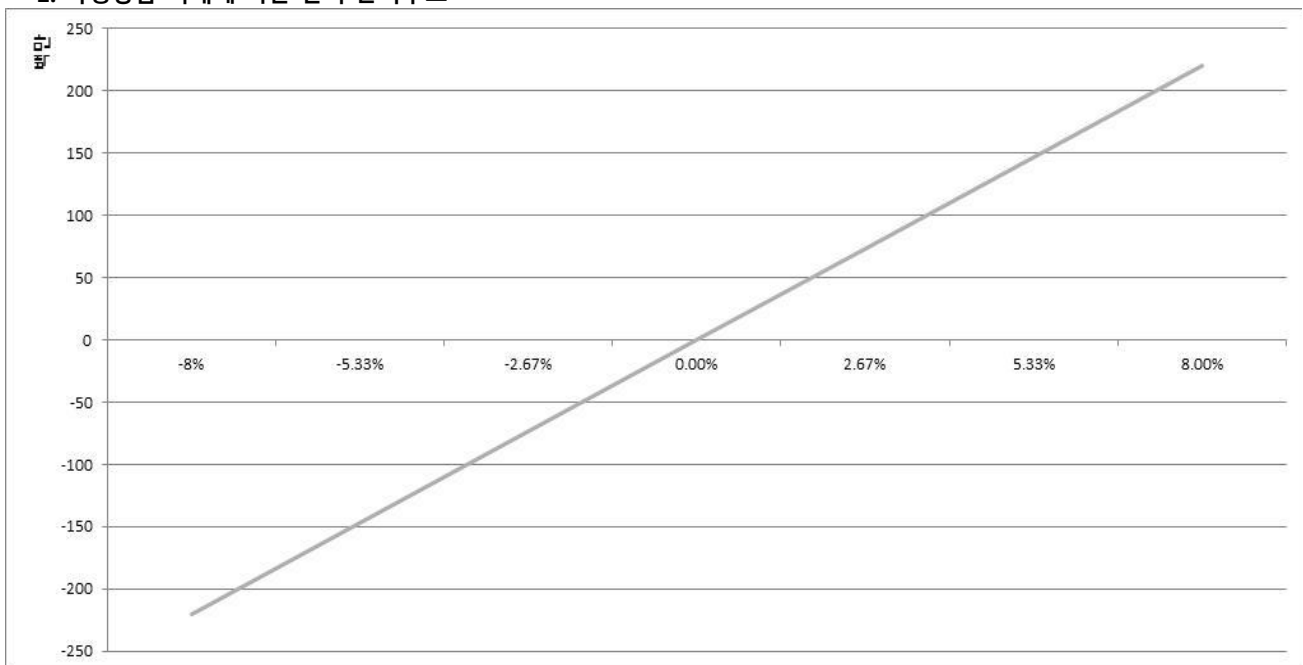
공시일: 2021-05-27

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	2,753	0	2,753	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,799	0	11,799	장내
합계			14,552	0	14,552	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

220

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,343

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

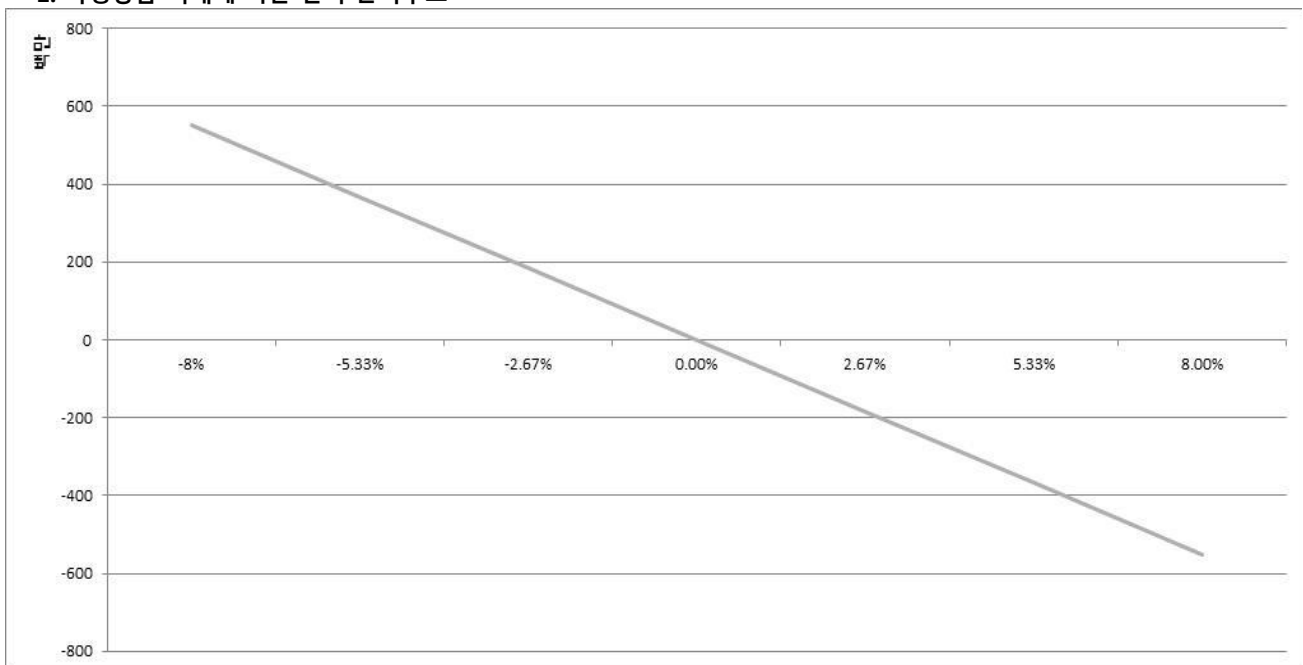
공시일: 2021-05-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	110	-110	장내
누계	주가지수	선물	0	6,918	-6,918	장내
신규	주식	주식	87	0	87	장내
누계	주식	주식	7,031	0	7,031	장내
합계			7,031	6,918	113	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

553

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

428

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

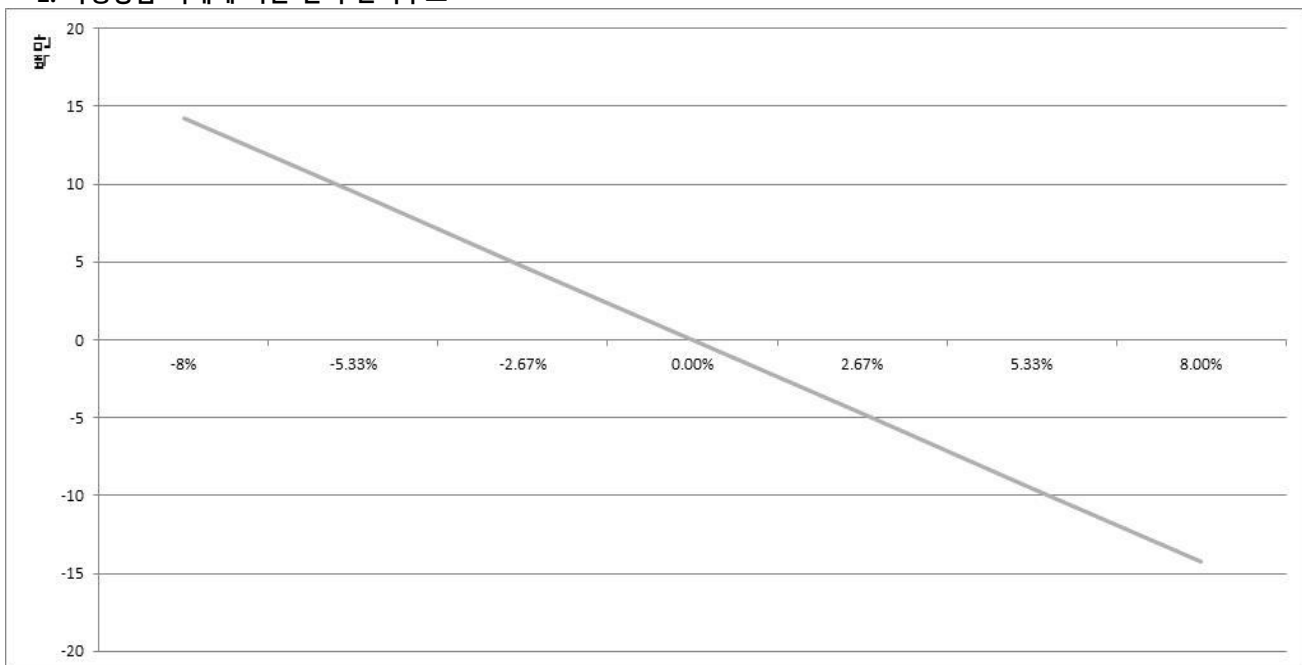
공시일: 2021-05-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	28	28	0	장내
누계	주식	주식	4,698	919	3,779	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	666	-666	장내
합계			4,698	1,585	3,113	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

282

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

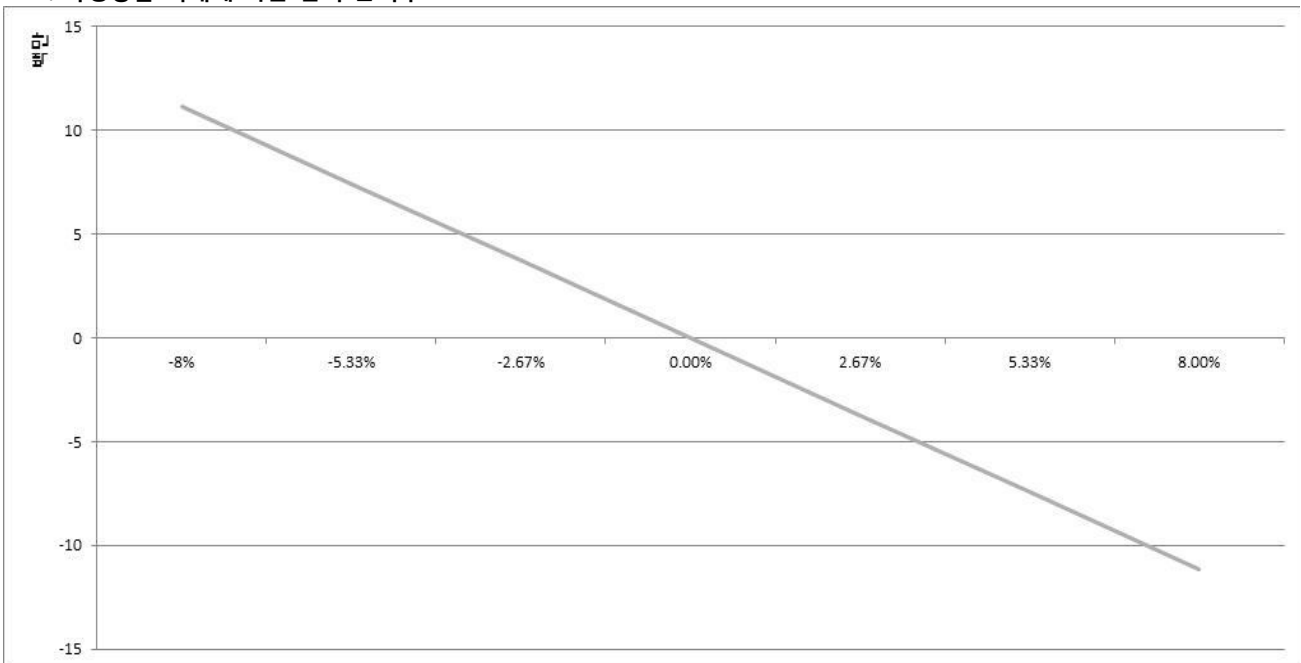
공시일: 2021-05-27

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	41	-41	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	1,522	1,409	113	장외
합계			2,123	1,449	674	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

120