펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

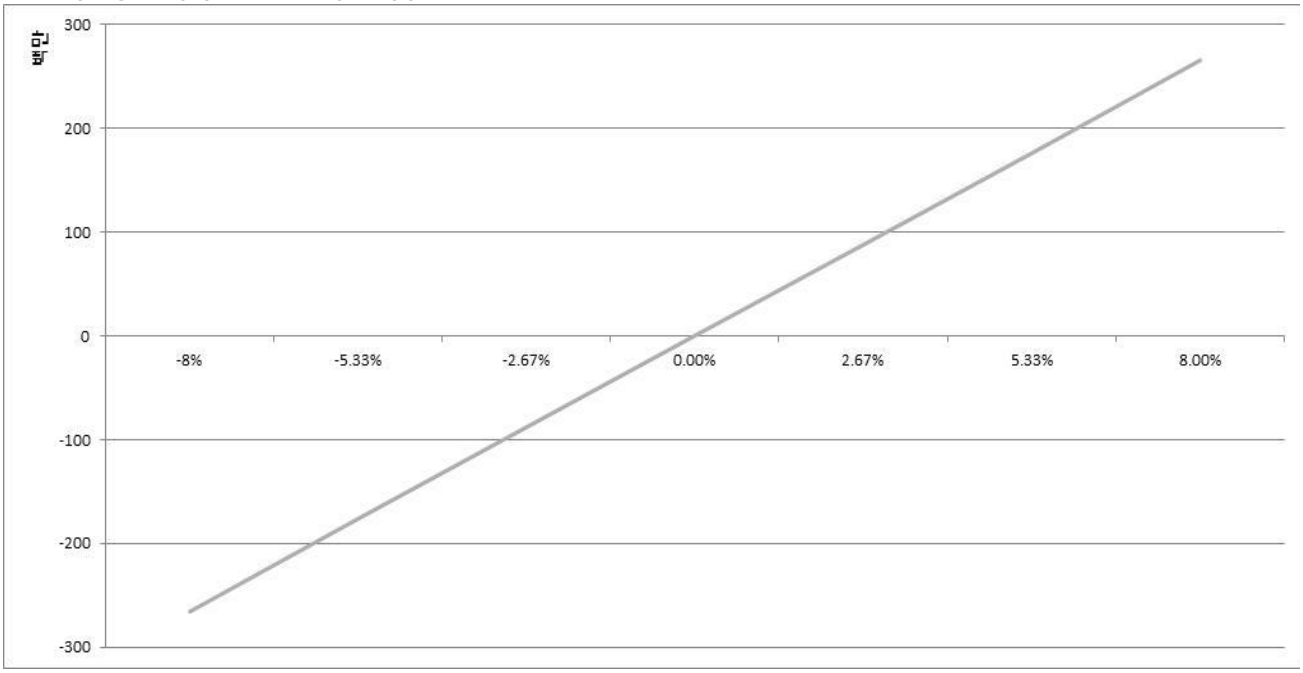
공시일: 2021-06-23

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	2,281	0	2,281	장내
신규	주식	주식	15	0	15	장내
누계	주식	주식	13,497	0	13,497	장내
합계			15,778	0	15,778	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	182

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	1,267

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

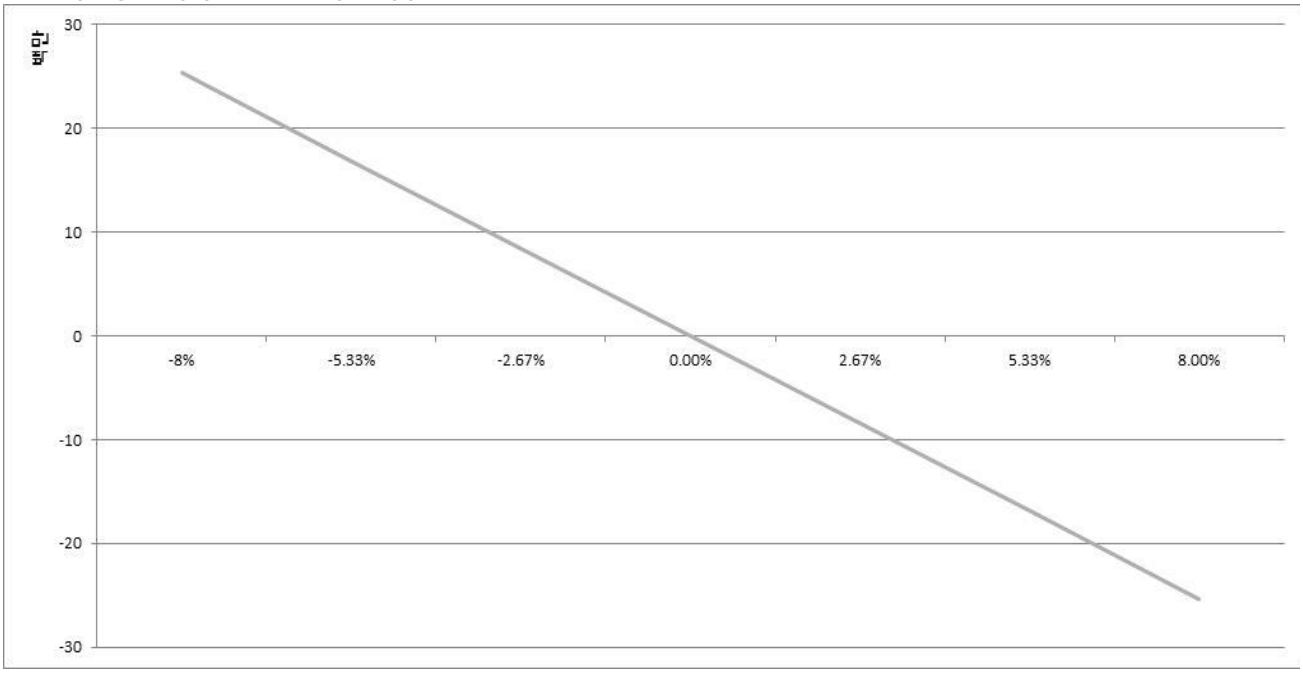
공시일: 2021-06-23

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	11,059	-11,059	장내
신규	주식	주식	125	0	125	장내
누계	주식	주식	11,659	0	11,659	장내
합계			11,659	11,059	600	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

876

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

483

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

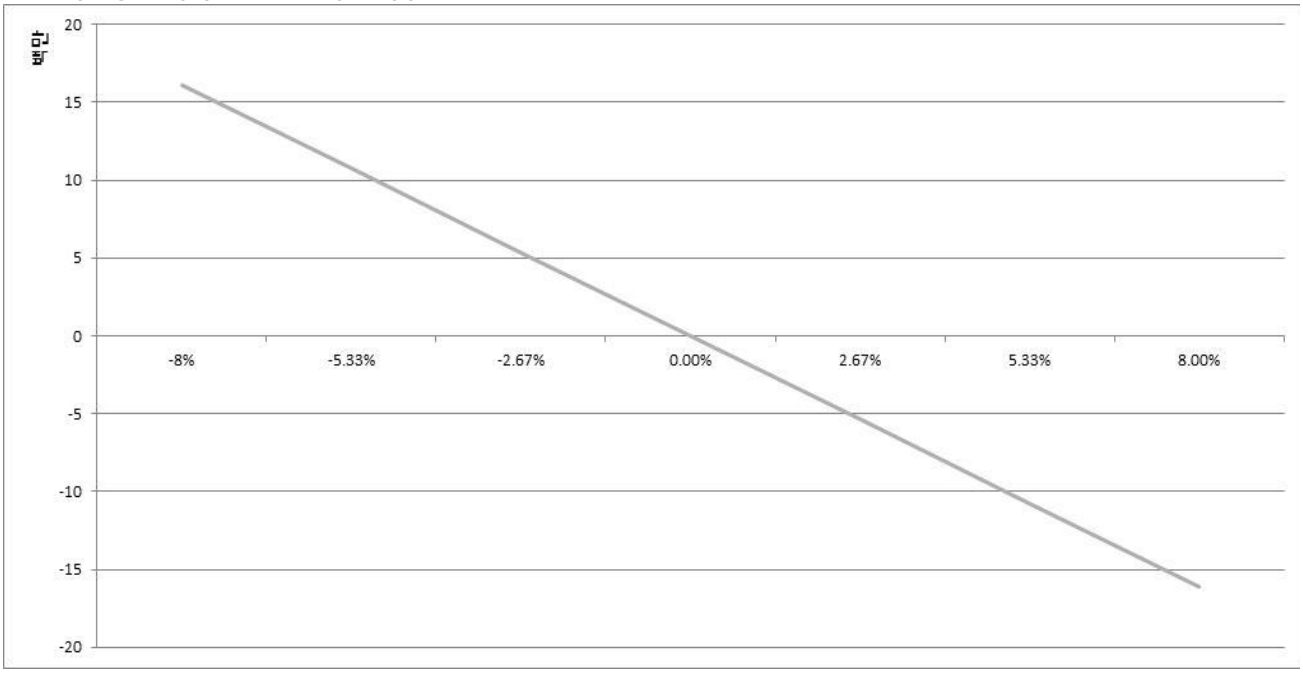
공시일: 2021-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	187	271	-85	장내
누계	주식	주식	5,115	874	4,241	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	616	-616	장내
합계			5,115	1,490	3,625	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

333

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

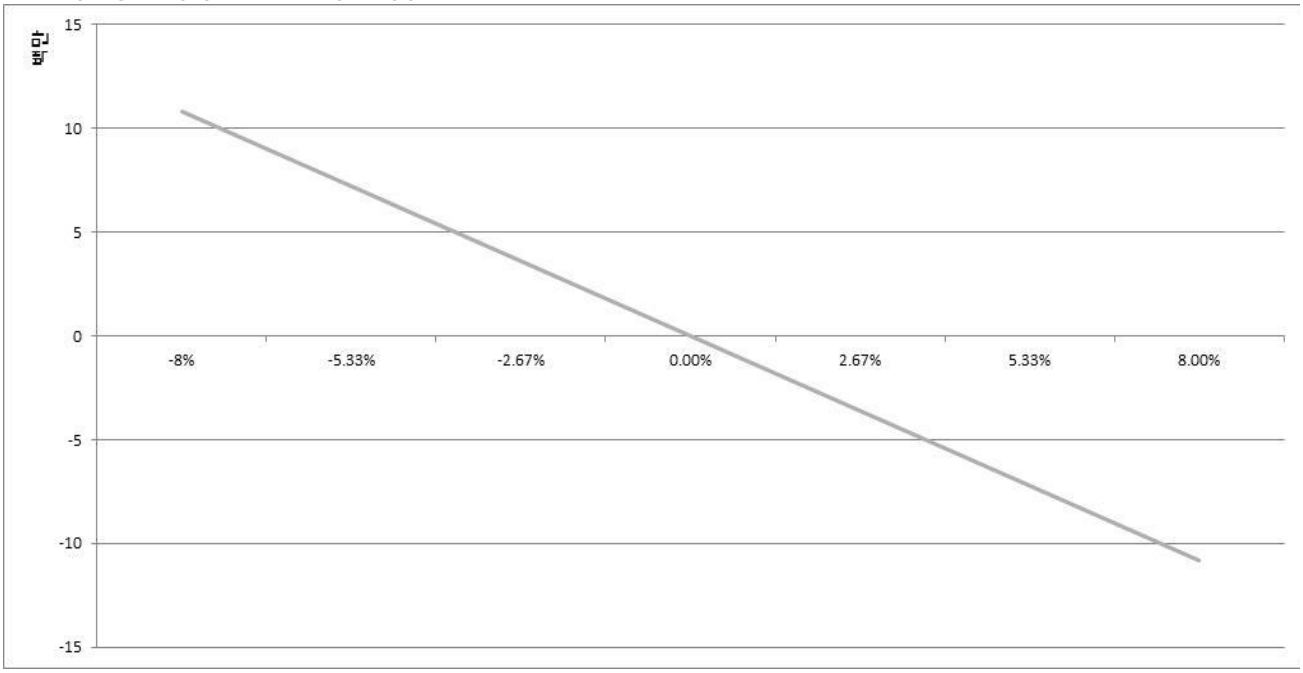
공시일: 2021-06-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	3	0	3	장내
누계	주식	주식	310	0	310	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4	0	4	장외
합계			314	0	314	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

1