

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

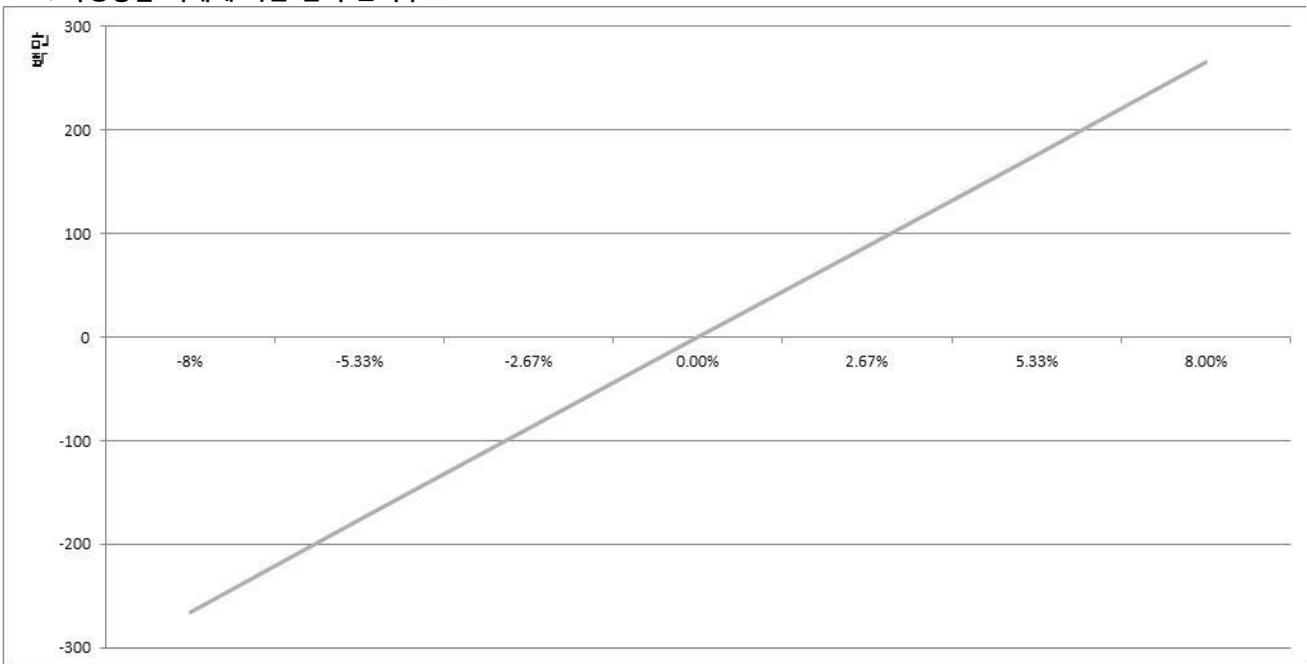
공시일: 2021-06-24

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	2,184	-2,184	장내
누계	주가지수	선물	109	0	109	장내
신규	주식	주식	6	1,657	-1,651	장내
누계	주식	주식	11,922	0	11,922	장내
합계			12,031	0	12,031	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,171

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

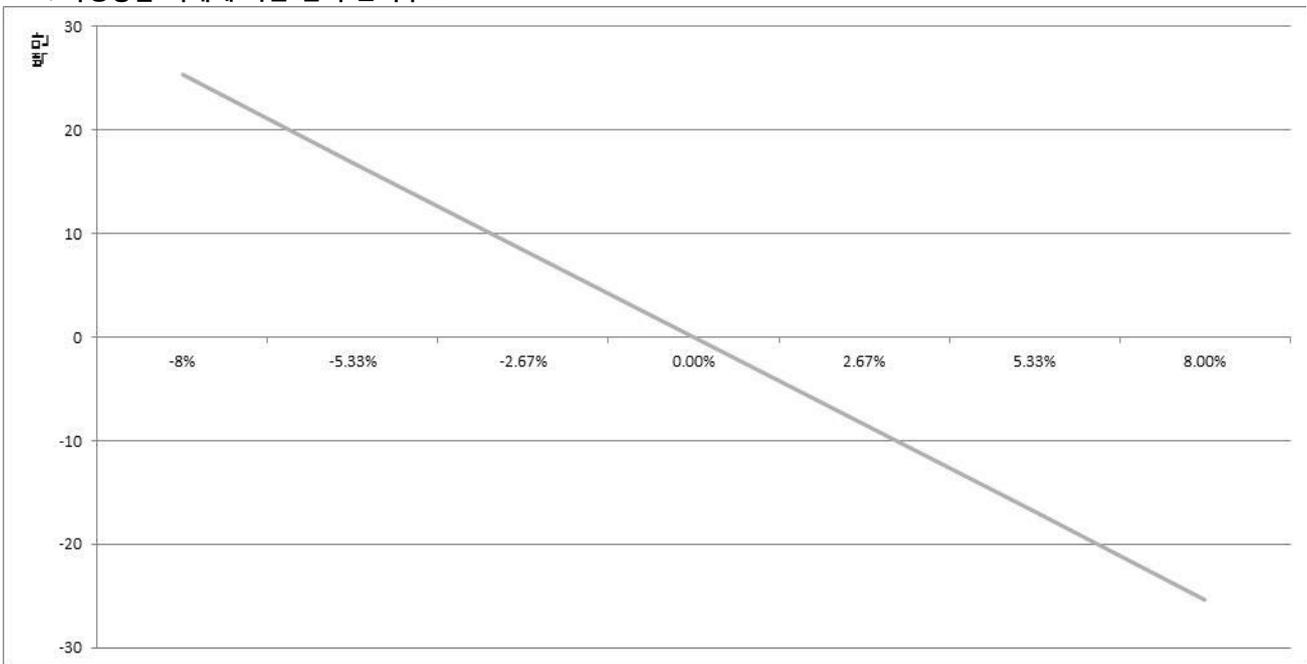
공시일: 2021-06-24

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	11,159	-11,159	장내
신규	주식	주식	16	234	-218	장내
누계	주식	주식	11,597	0	11,597	장내
합계			11,597	11,159	438	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

884

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

484

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

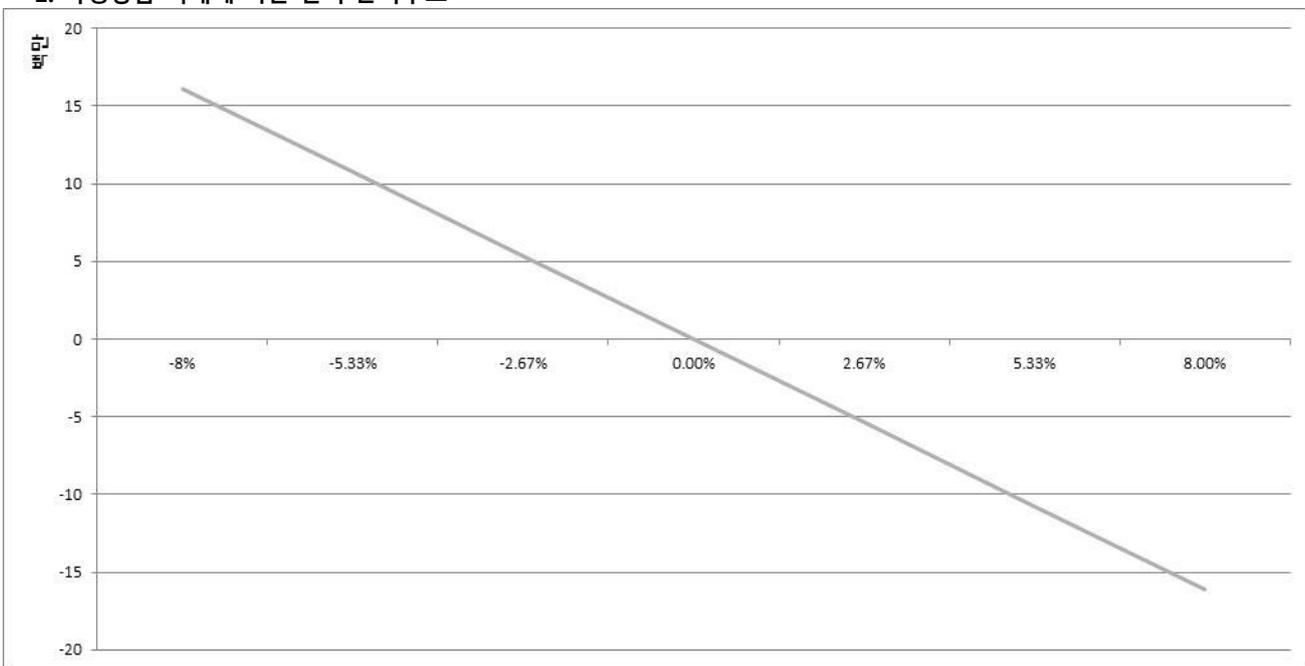
공시일: 2021-06-24

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	5,145	866	4,279	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	612	-612	장내
합계			5,145	1,478	3,667	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

337

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

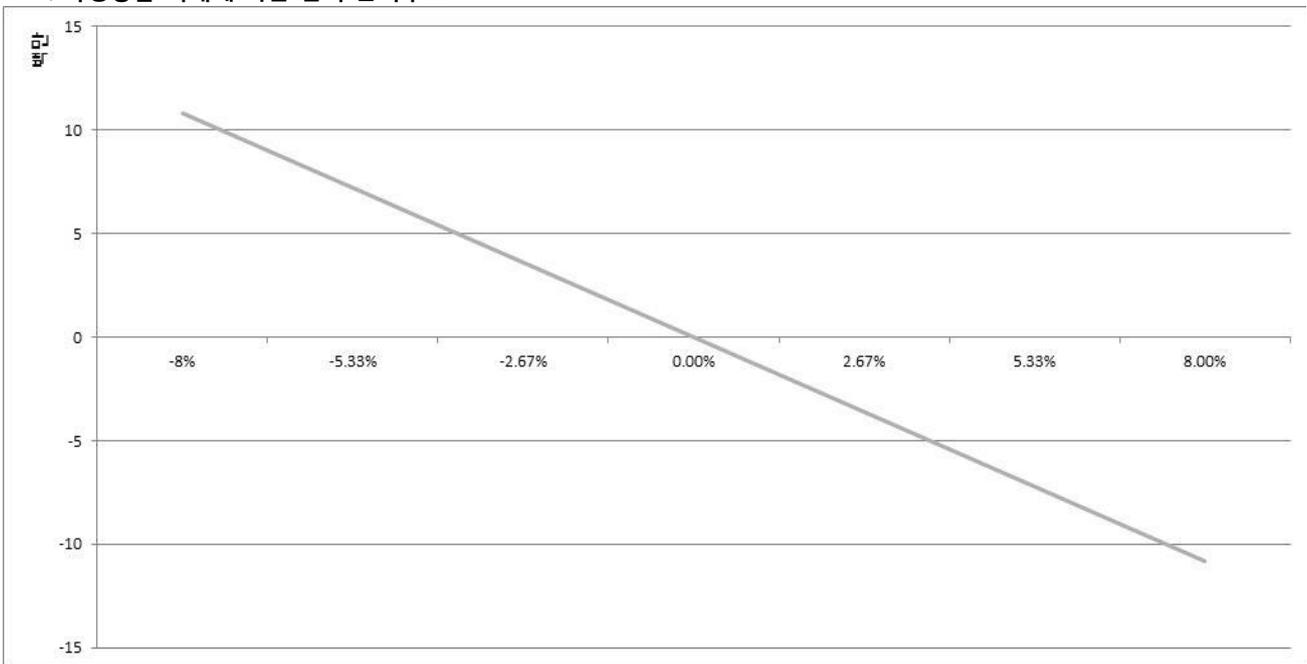
공시일: 2021-06-24

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	325	0	325	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4	0	4	장외
합계			329	0	329	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1