

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

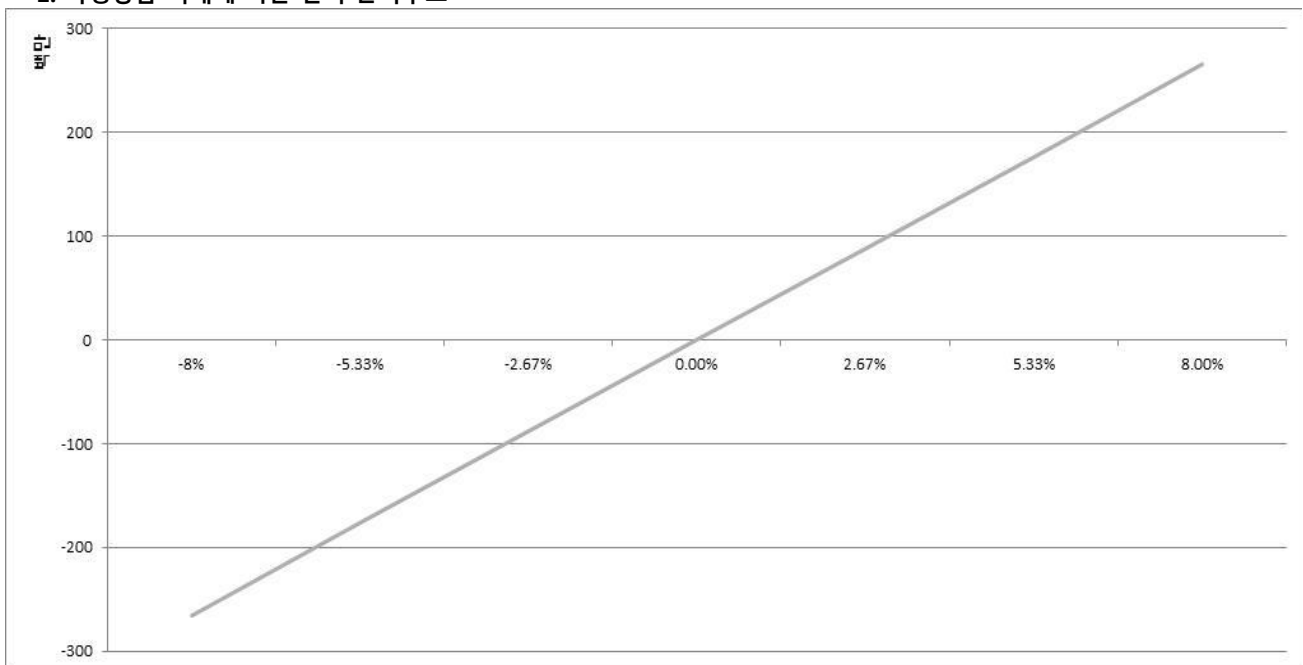
공시일: 2021-06-29

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	110	0	110	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	9,399	0	9,399	장내
합계			9,509	0	9,509	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

899

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

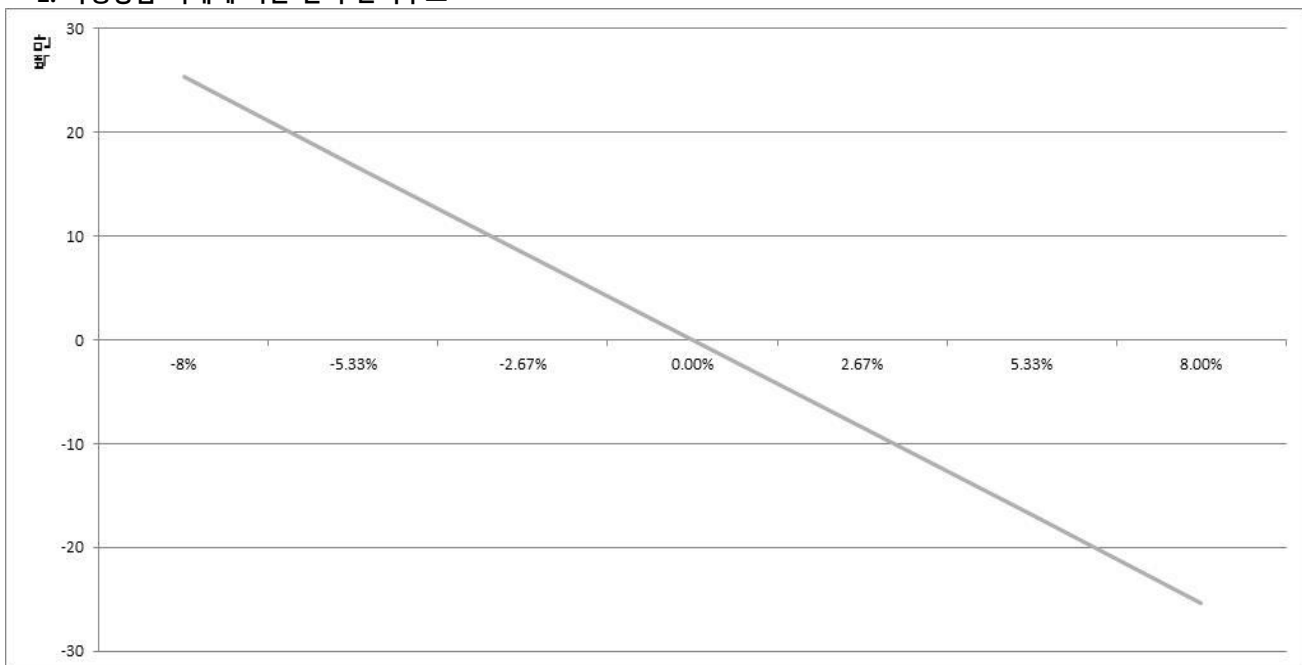
공시일: 2021-06-29

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	11,081	-11,081	장내
신규	주식	주식	3	0	3	장내
누계	주식	주식	11,526	0	11,526	장내
합계			11,526	11,081	446	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

878

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

483

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

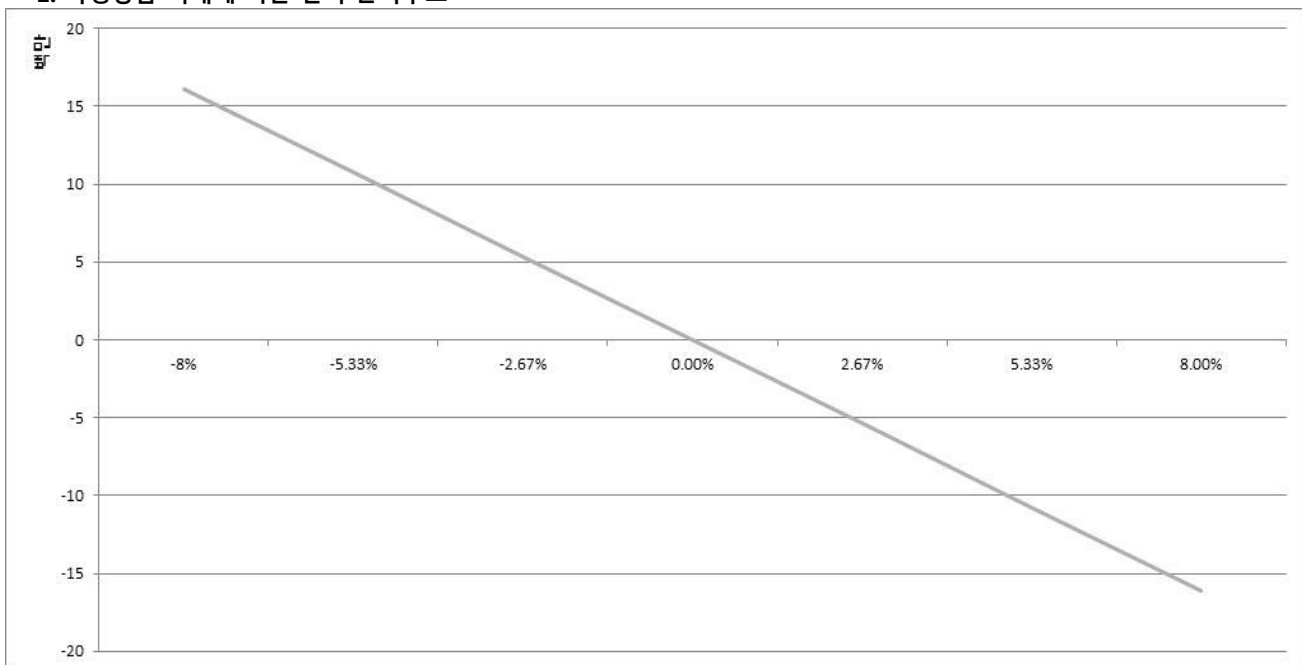
공시일: 2021-06-29

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	28	0	28	장내
누계	주식	주식	5,257	855	4,401	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	678	-678	장내
합계			5,257	1,533	3,723	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

390

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

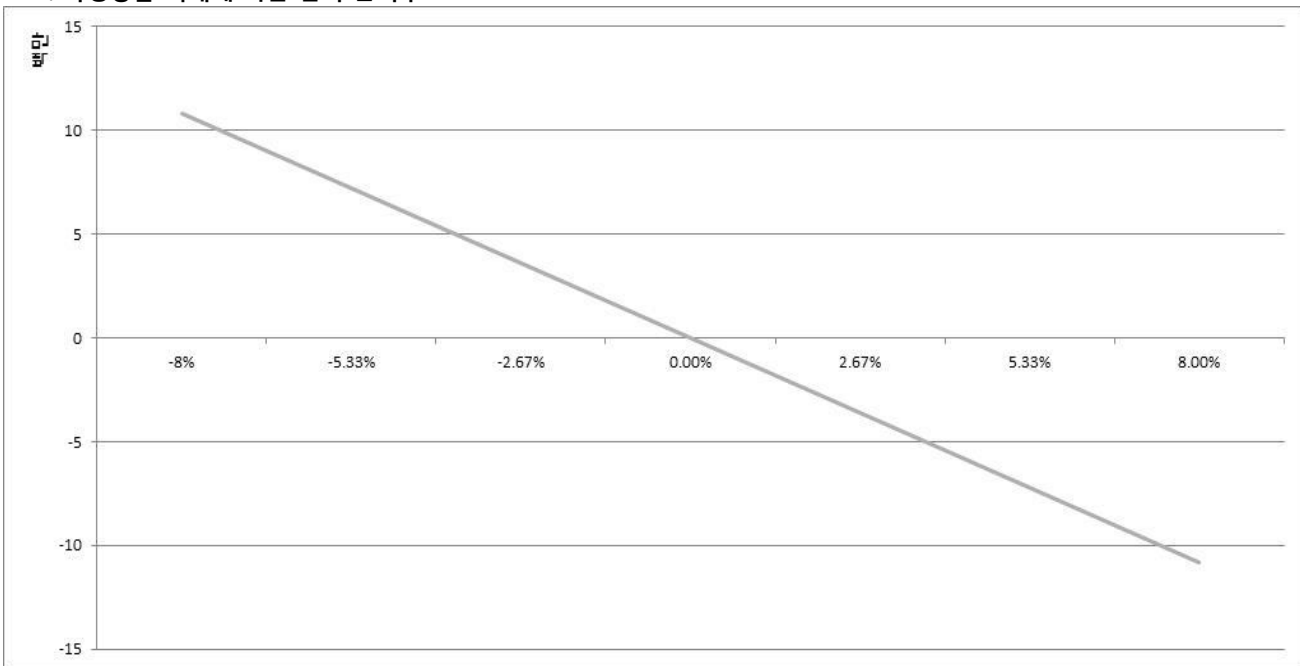
공시일: 2021-06-29

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	326	0	326	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4	0	4	장외
합계			330	0	330	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

69