

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

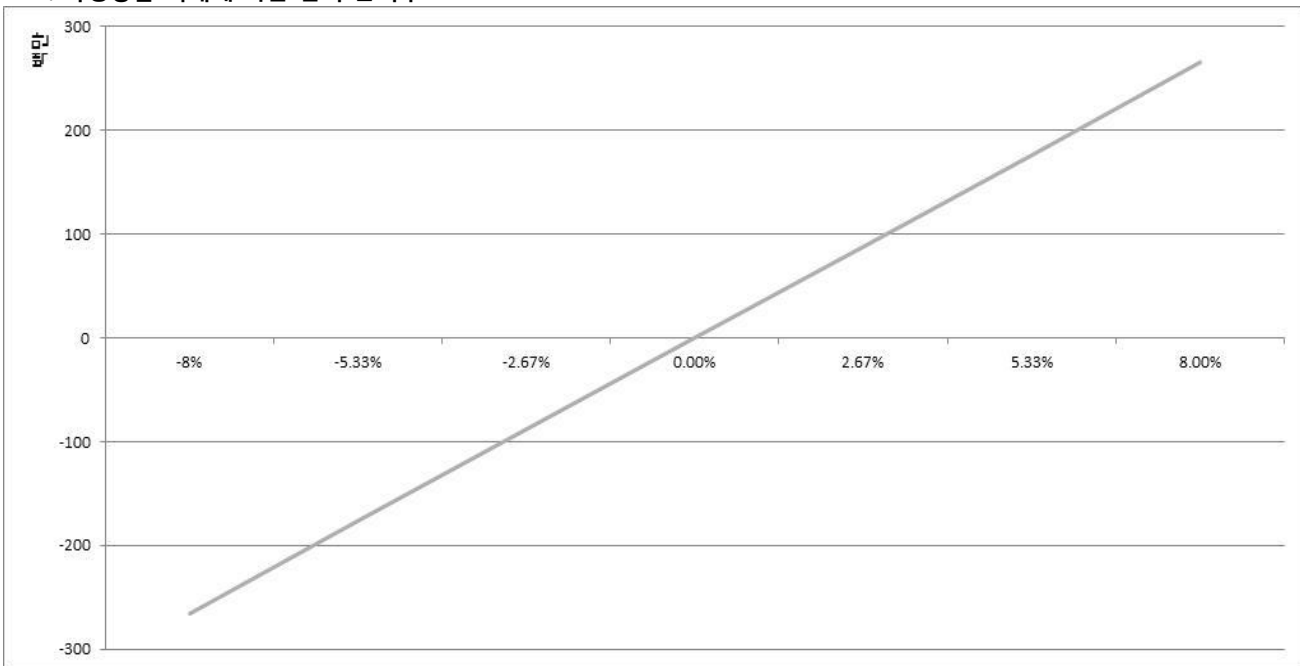
공시일: 2021-06-30

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	109	0	109	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	9,349	0	9,349	장내
합계			9,458	0	9,458	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

896

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

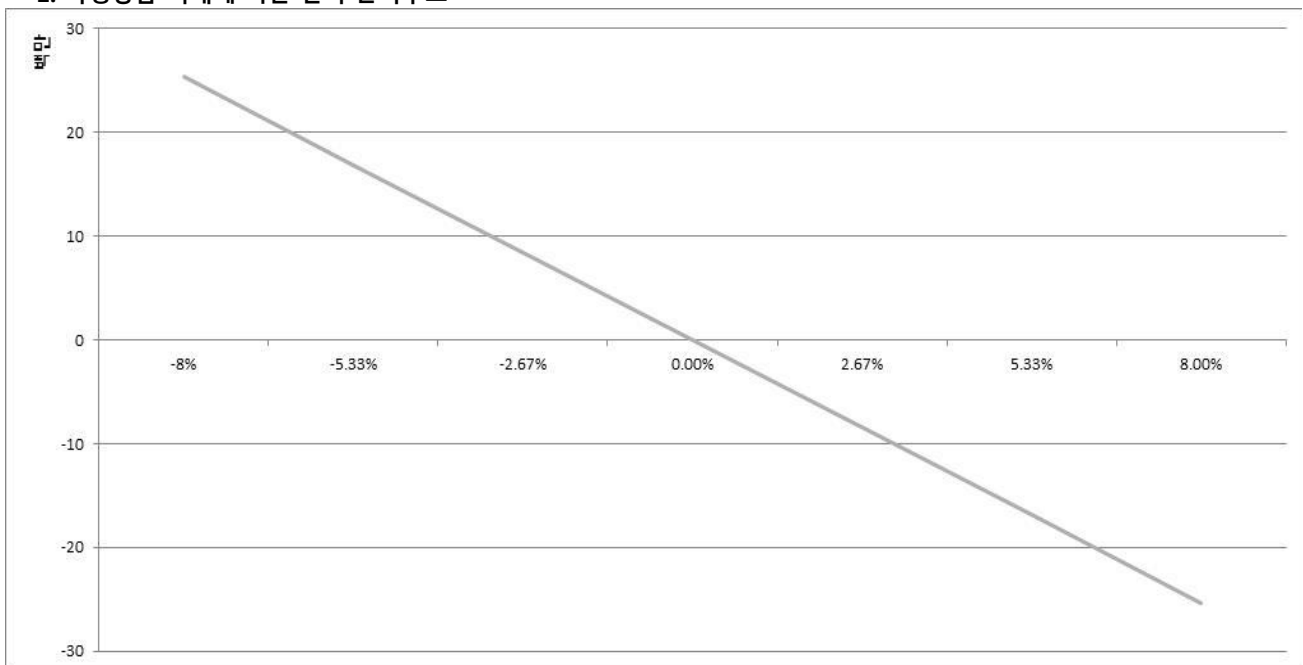
공시일: 2021-06-30

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	11,147	-11,147	장내
신규	주식	주식	0	311	-311	장내
누계	주식	주식	11,289	0	11,289	장내
합계			11,289	11,147	142	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

882

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

414

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

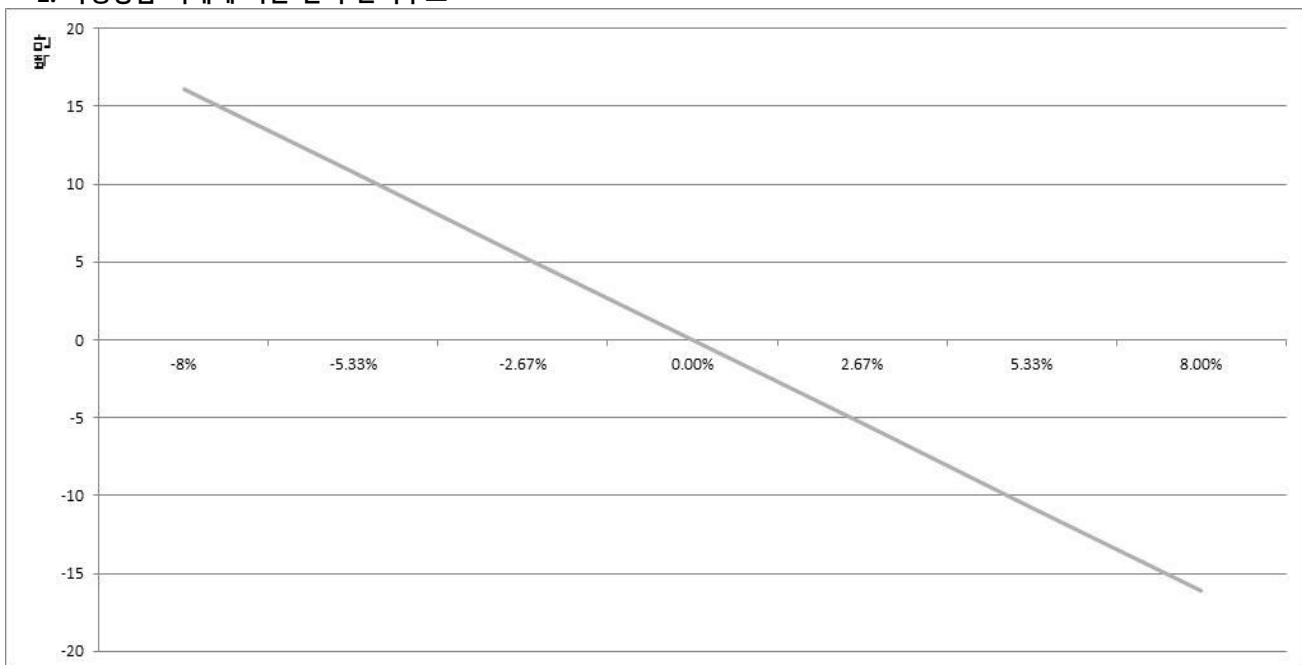
공시일: 2021-06-30

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	5,247	858	4,389	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	673	-673	장내
합계			5,247	1,531	3,716	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

387

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

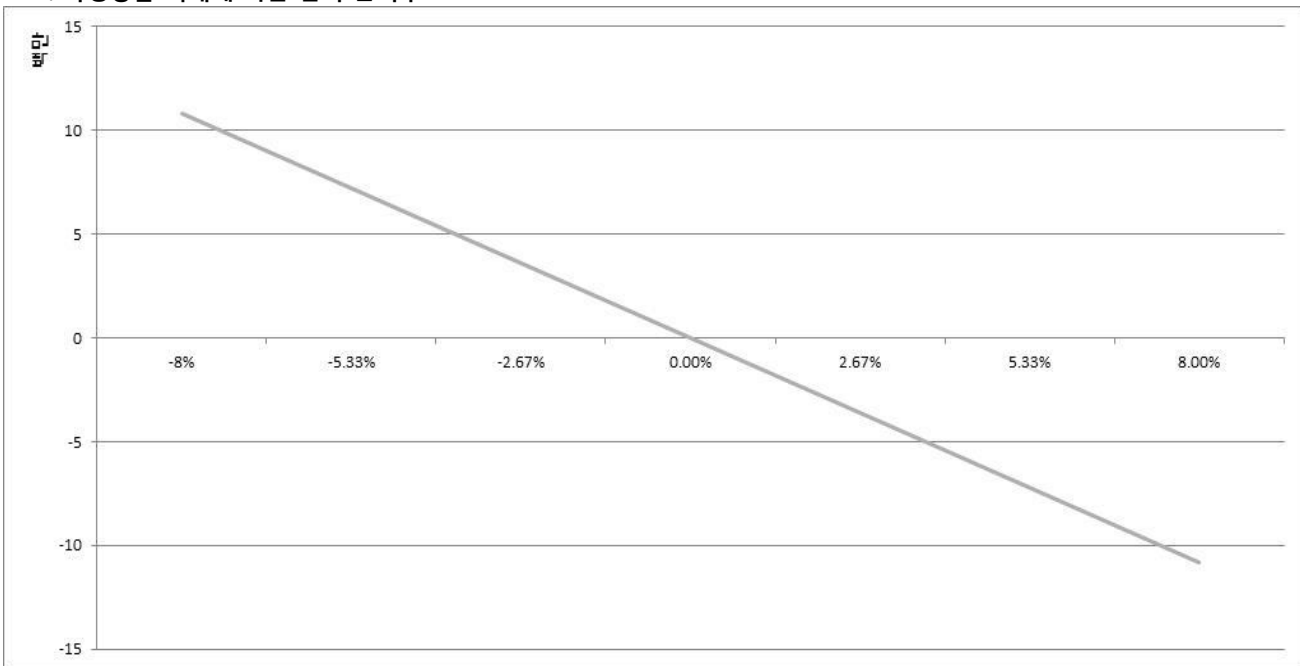
공시일: 2021-06-30

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	337	0	337	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4	0	4	장외
합계			341	0	341	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

72