

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

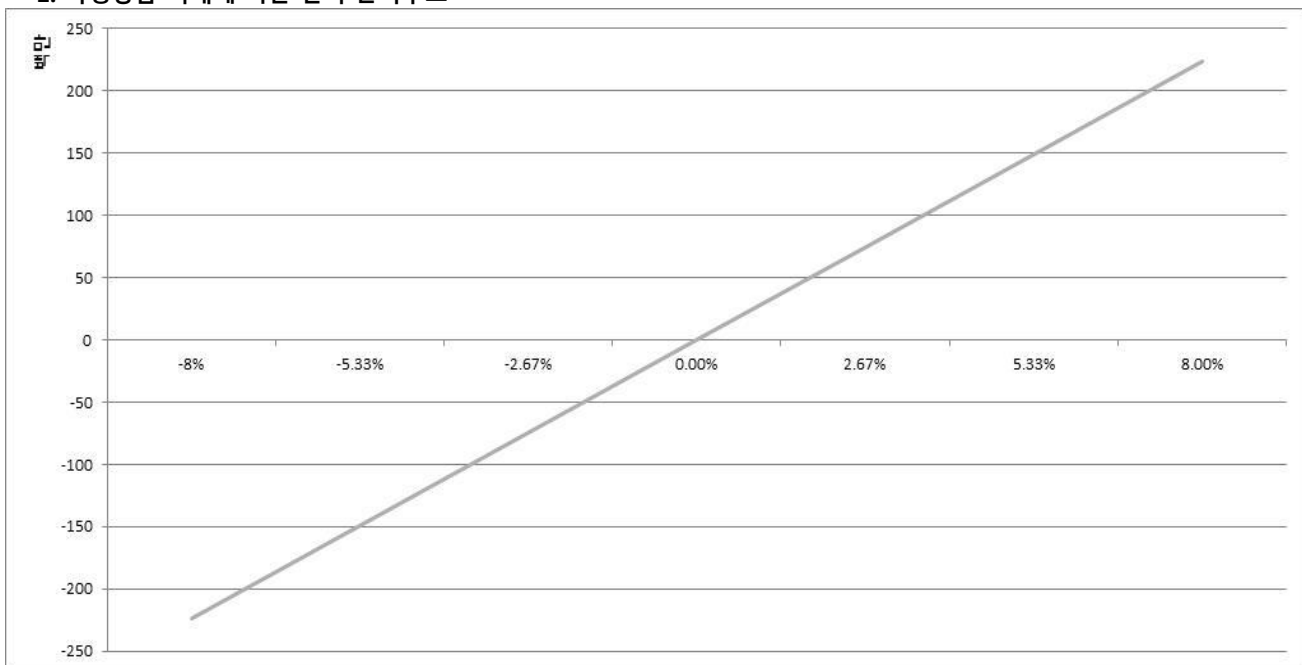
공시일: 2021-06-02

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	2,797	0	2,797	장내
신규	주식	주식	4	0	4	장내
누계	주식	주식	11,970	0	11,970	장내
합계			14,767	0	14,767	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

224

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,369

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

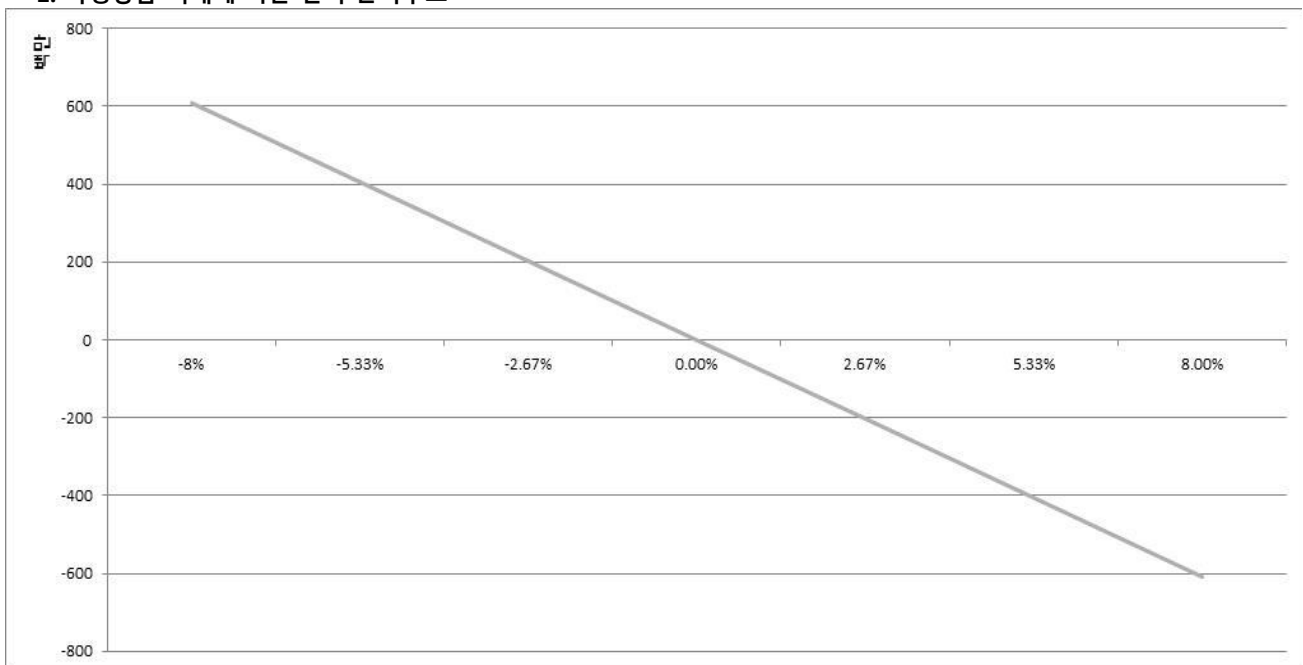
공시일: 2021-06-02

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	7,604	-7,604	장내
신규	주식	주식	59	0	59	장내
누계	주식	주식	7,800	0	7,800	장내
합계			7,800	7,604	196	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

608

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

465

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

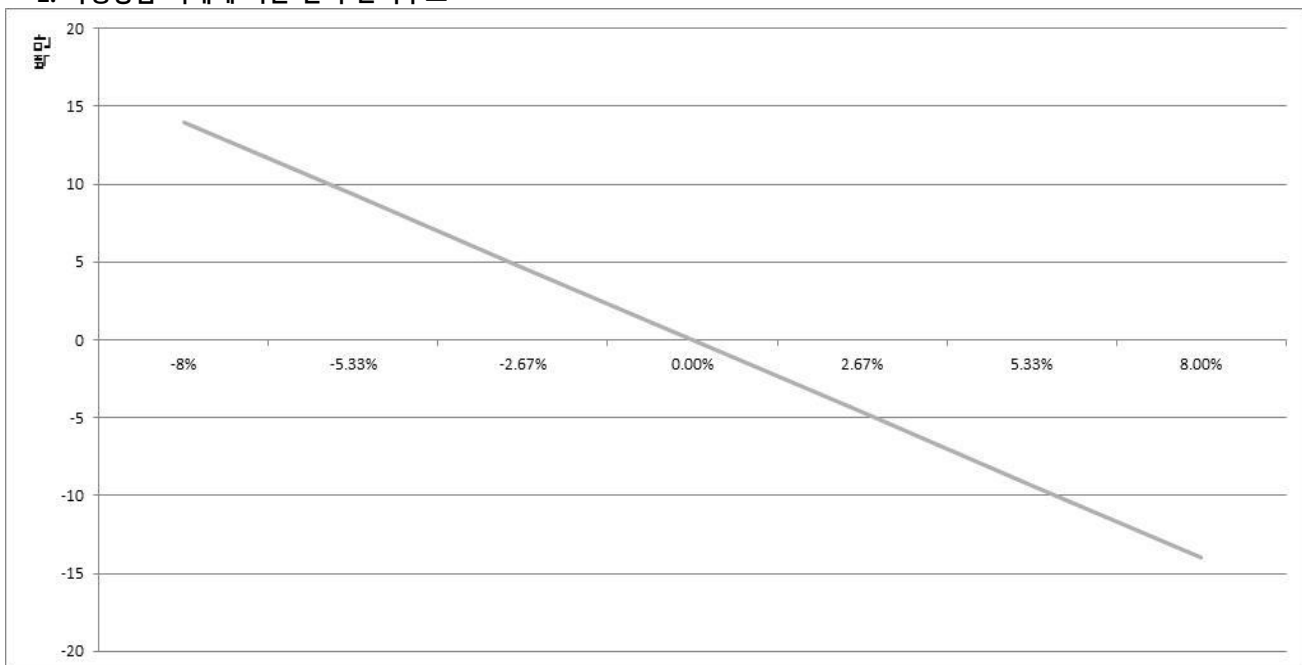
공시일: 2021-06-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	19	56	-37	장내
누계	주식	주식	4,887	738	4,149	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	689	-689	장내
합계			4,887	1,427	3,460	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

307

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

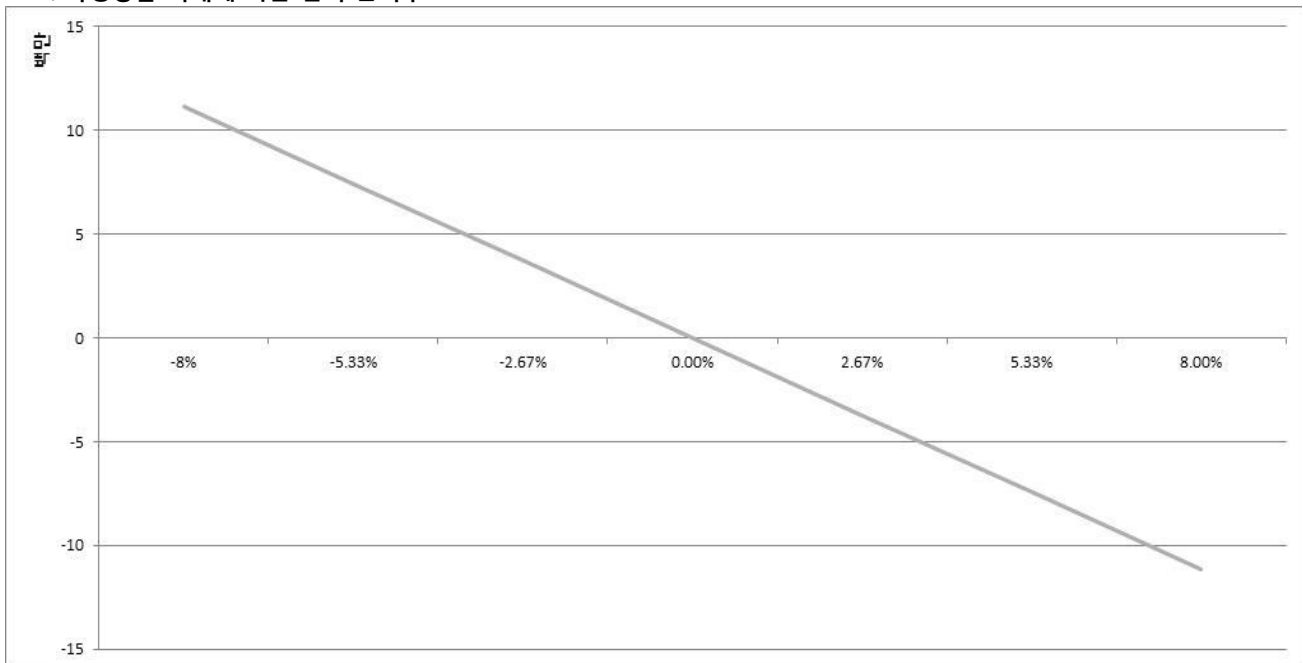
공시일: 2021-06-02

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	620	0	620	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	40	-40	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	1,523	1,391	132	장외
합계			2,143	1,431	712	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

119