

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

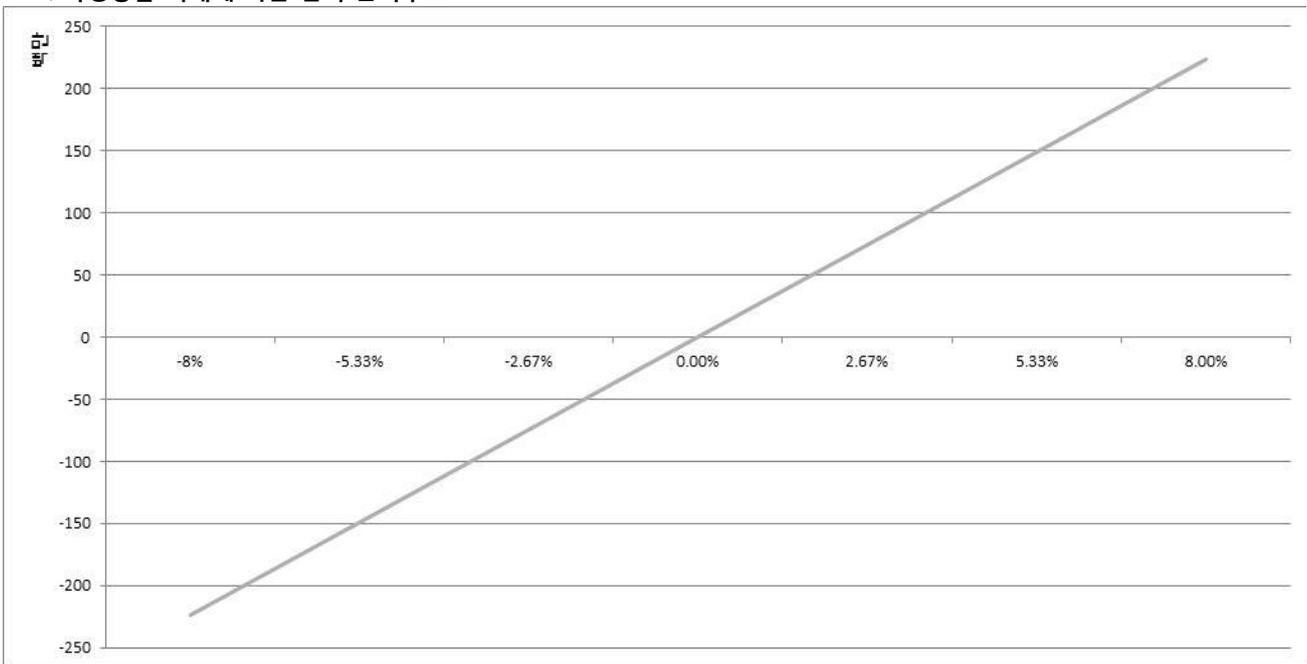
공시일: 2021-06-03

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	2,796	0	2,796	장내
신규	주식	주식	9	5	4	장내
누계	주식	주식	11,968	0	11,968	장내
합계			14,764	0	14,764	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

223

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,367

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

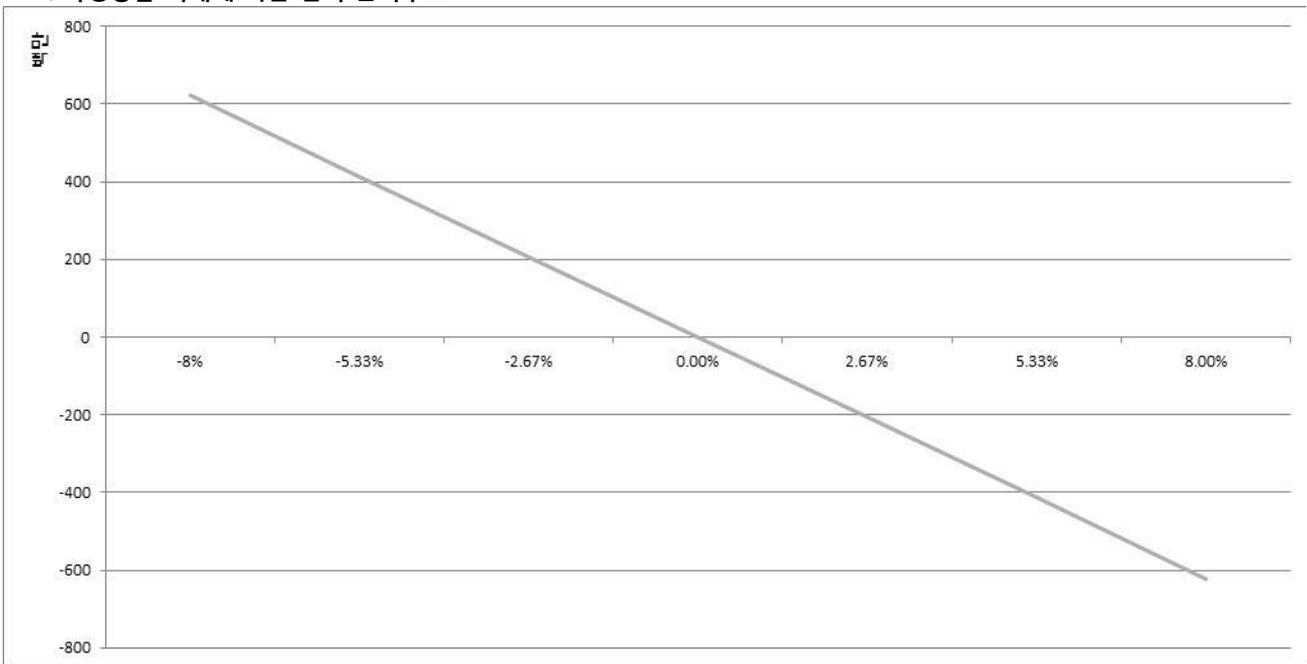
공시일: 2021-06-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	277	-277	장내
누계	주가지수	선물	0	7,791	-7,791	장내
신규	주식	주식	40	0	40	장내
누계	주식	주식	7,728	0	7,728	장내
합계			7,728	7,791	-63	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

622

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

474

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

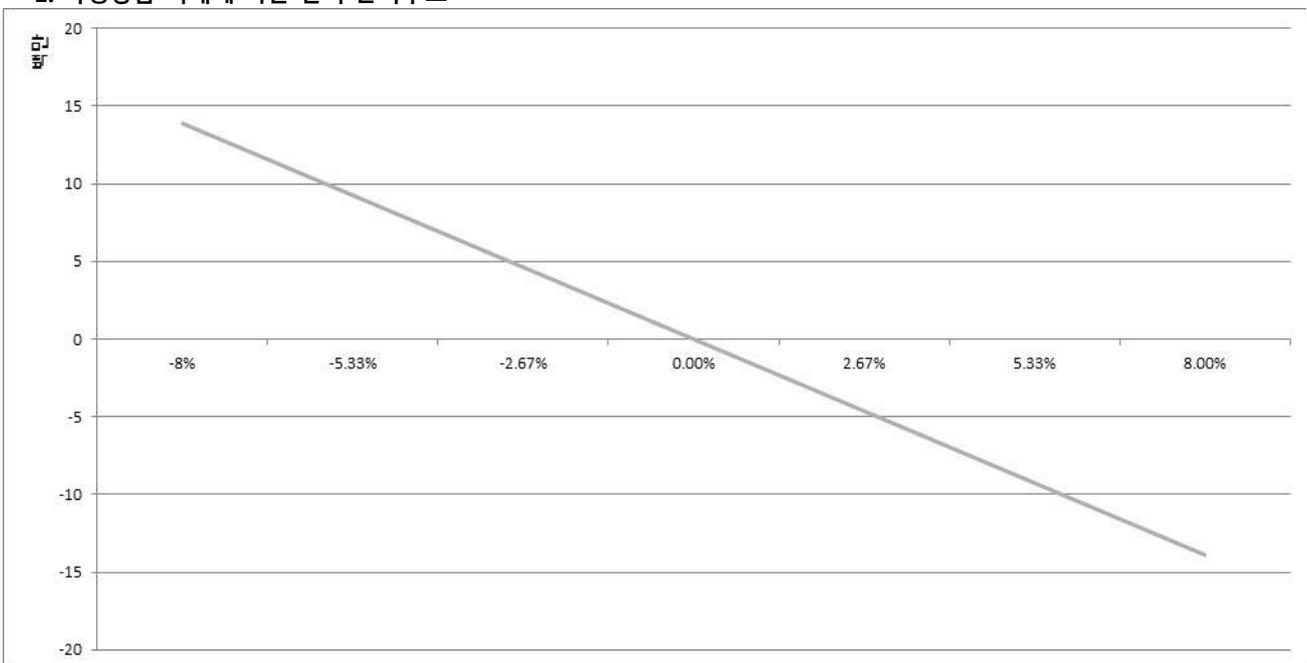
공시일: 2021-06-03

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	134	137	-4	장내
누계	주식	주식	4,873	728	4,145	장내
신규	유가증권	선물	83	0	83	장내
누계	유가증권	선물	0	601	-601	장내
합계			4,873	1,329	3,544	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

321

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

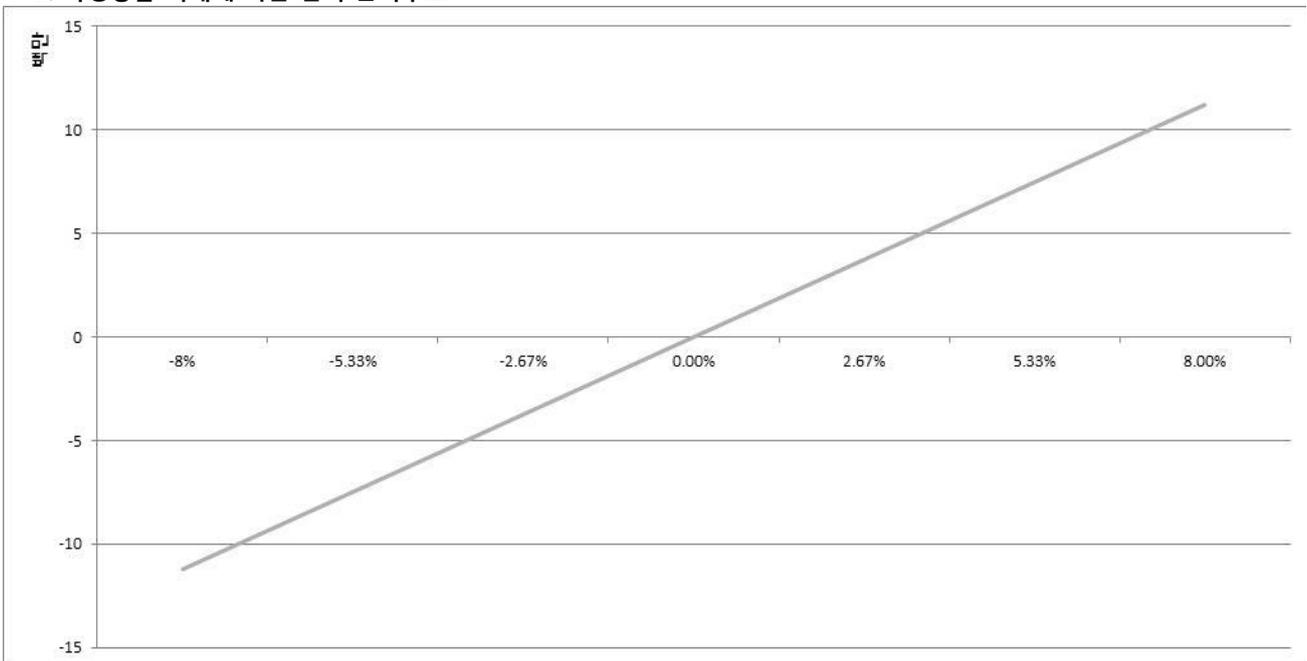
공시일: 2021-06-03

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	622	0	622	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	39	-39	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	1,539	1,406	133	장외
합계			2,161	1,445	716	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

125