

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

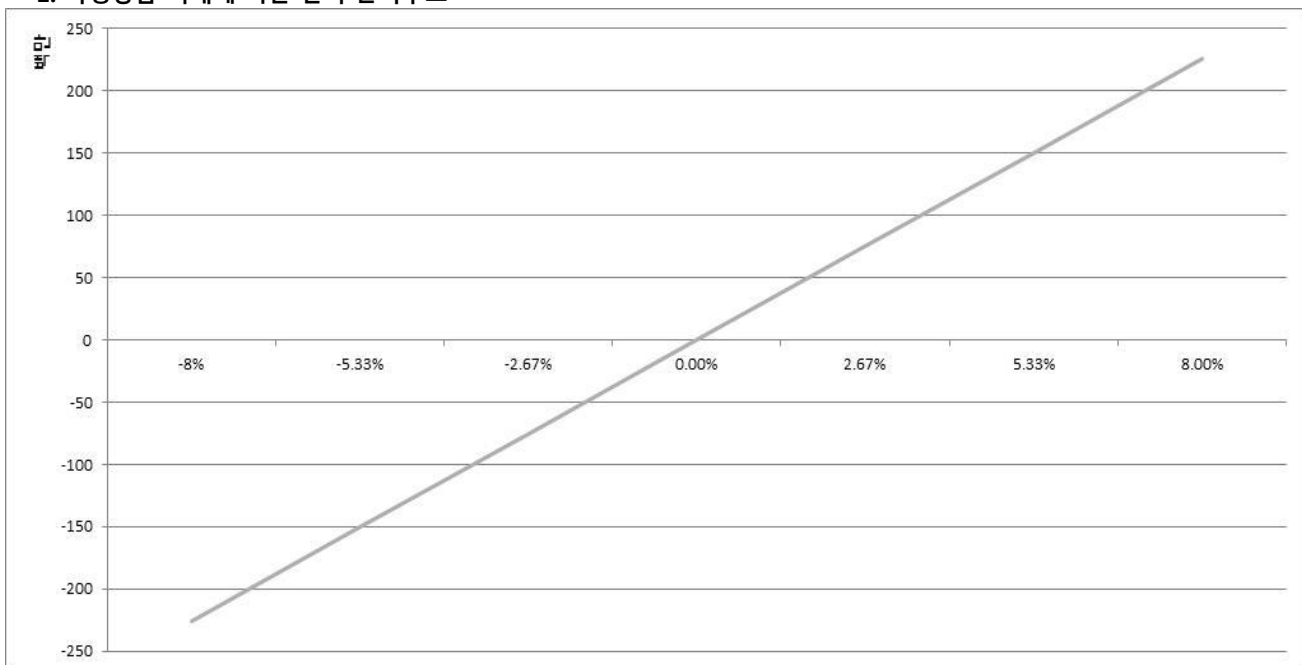
공시일: 2021-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	976	976	0	장내
누계	주가지수	선물	2,820	0	2,820	장내
신규	주식	주식	983	1	982	장내
누계	주식	주식	13,062	0	13,062	장내
합계			15,882	0	15,882	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

225

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,391

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

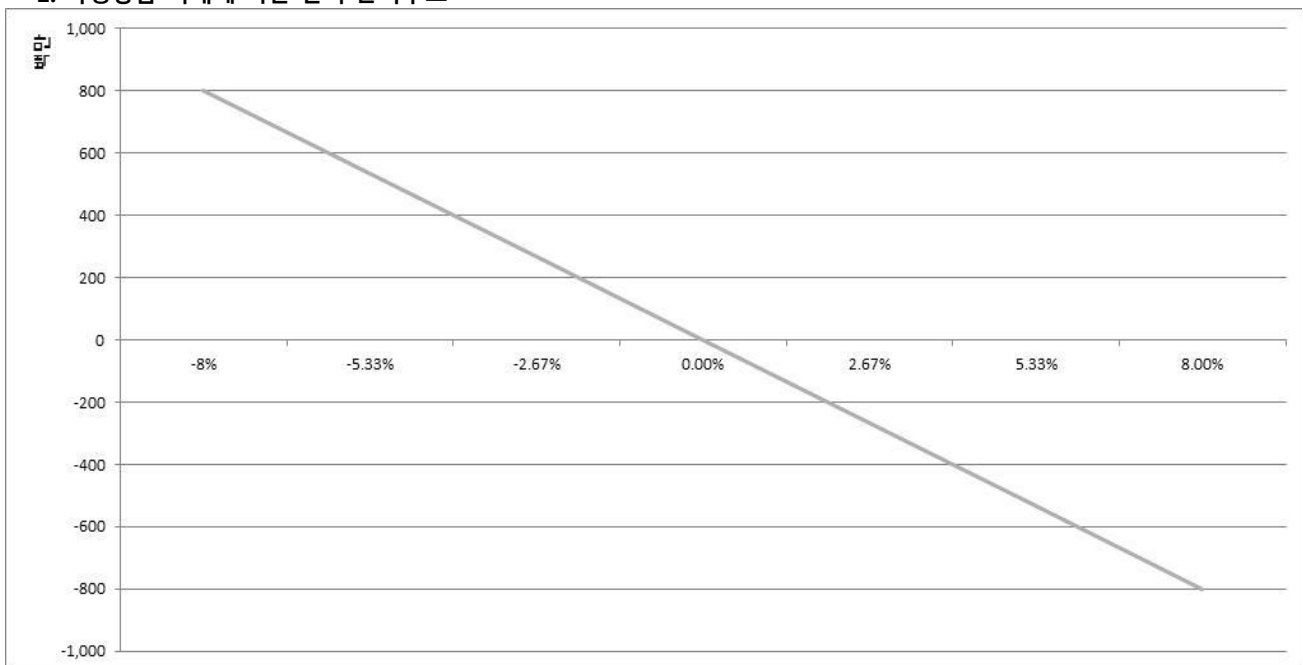
공시일: 2021-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	2,170	-2,170	장내
누계	주가지수	선물	0	10,051	-10,051	장내
신규	주식	주식	2,732	0	2,732	장내
누계	주식	주식	10,543	0	10,543	장내
합계			10,543	10,051	492	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

802

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

578

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

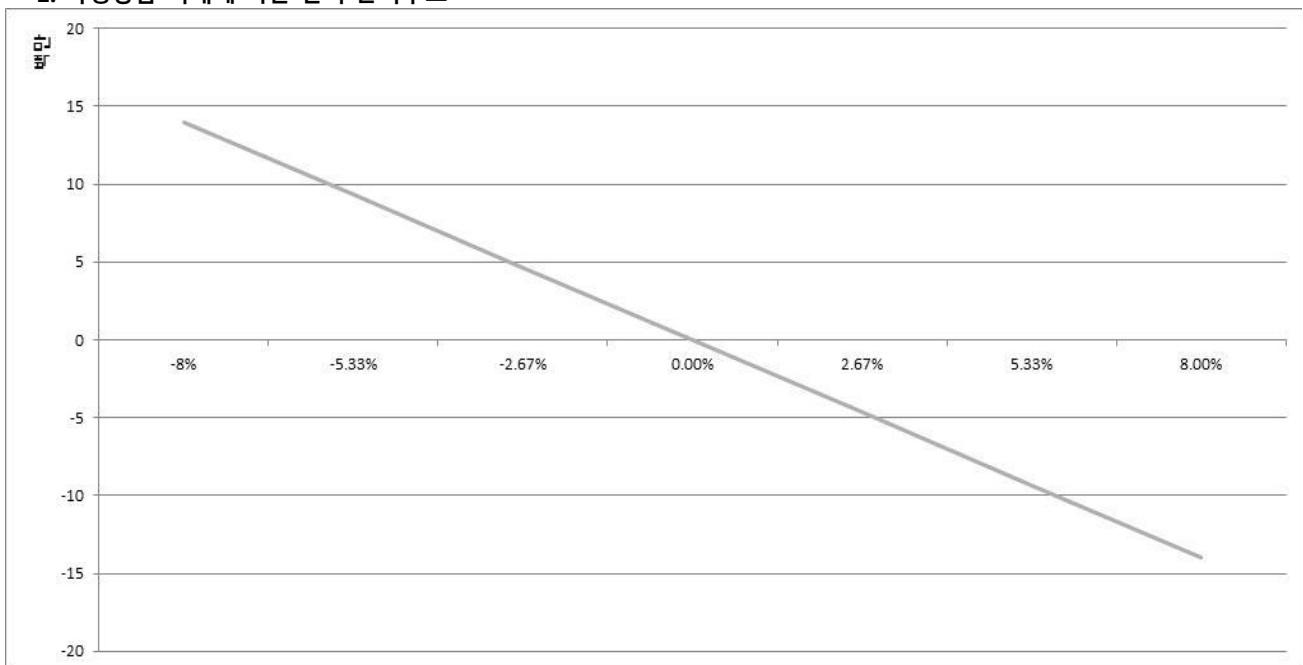
공시일: 2021-06-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	91	55	36	장내
누계	주식	주식	4,926	722	4,204	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	600	-600	장내
합계			4,926	1,322	3,604	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

328

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

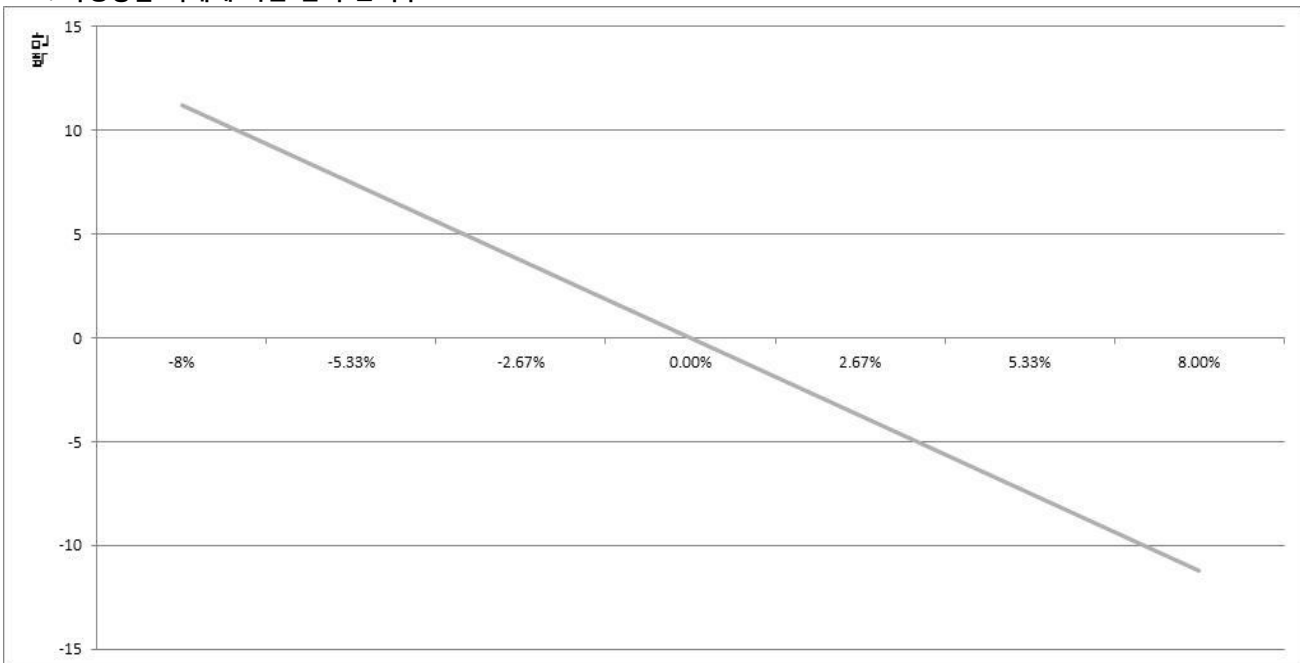
공시일: 2021-06-04

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	625	0	625	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	1,541	1,415	126	장외
합계			2,166	1,455	711	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

125