

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

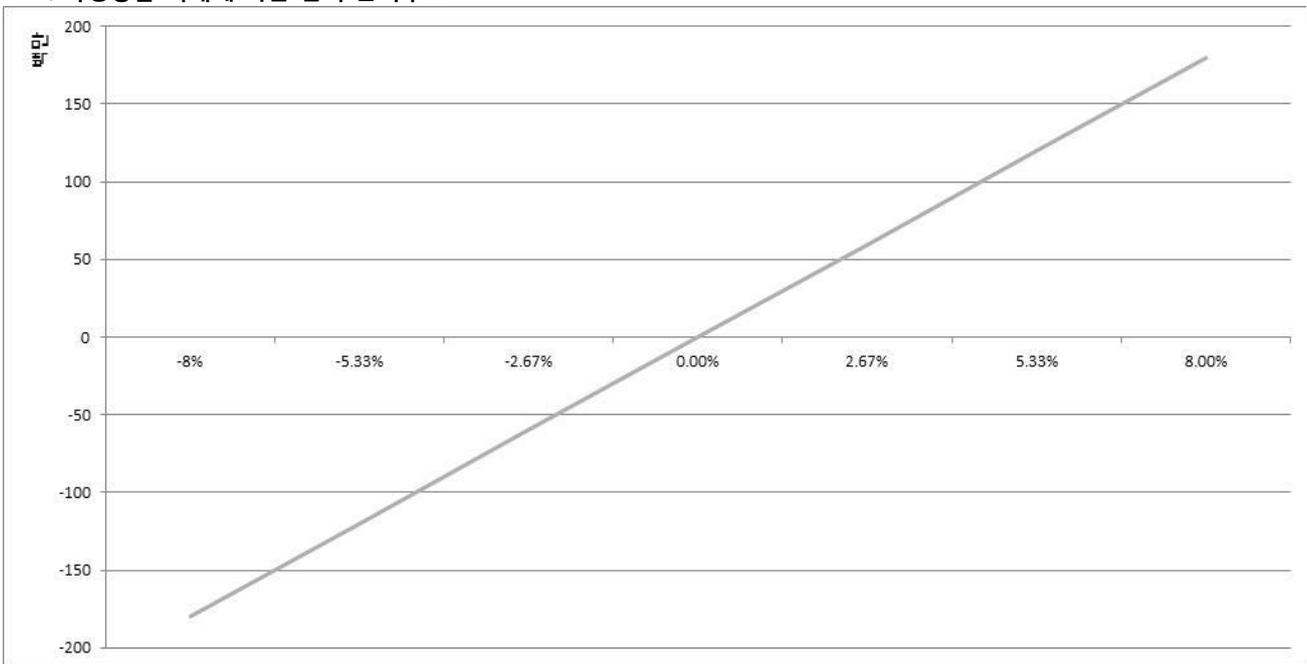
공시일: 2021-06-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	537	-537	장내
누계	주가지수	선물	2,254	0	2,254	장내
신규	주식	주식	576	67	510	장내
누계	주식	주식	13,432	0	13,432	장내
합계			15,686	0	15,686	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

180

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,395

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

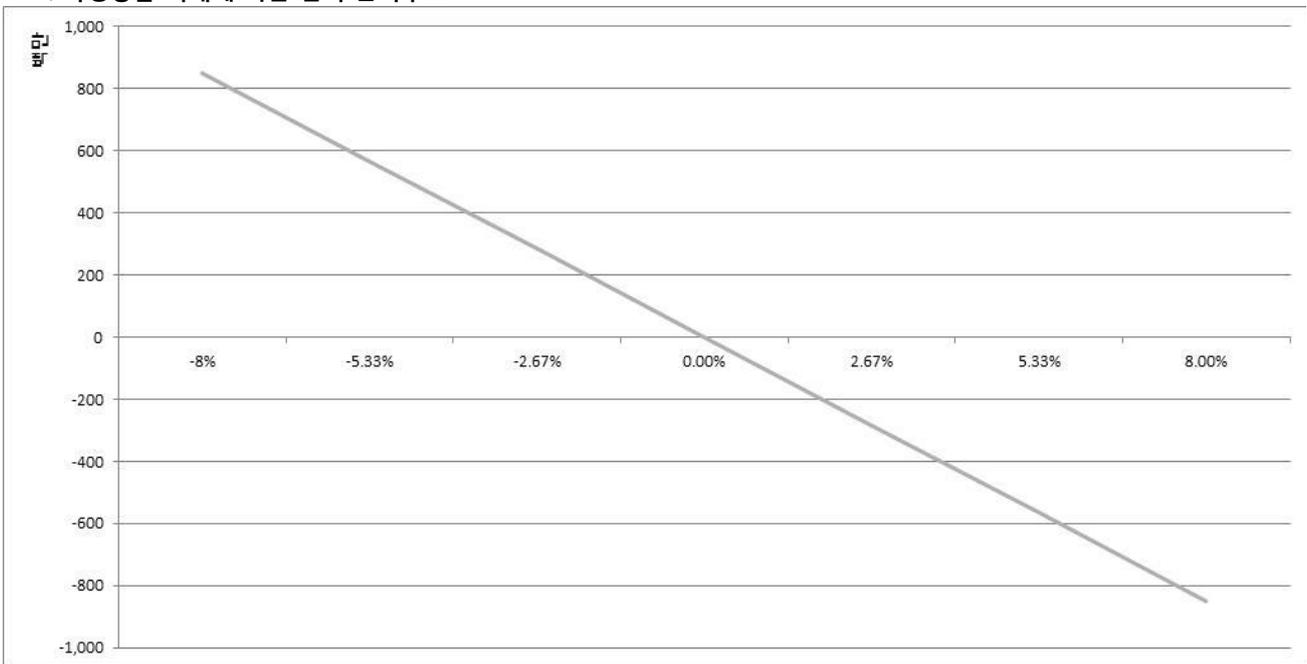
공시일: 2021-06-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	9,411	9,411	0	장내
누계	주가지수	선물	0	10,755	-10,755	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	10,990	0	10,990	장내
합계			10,990	10,755	235	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

850

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

479

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

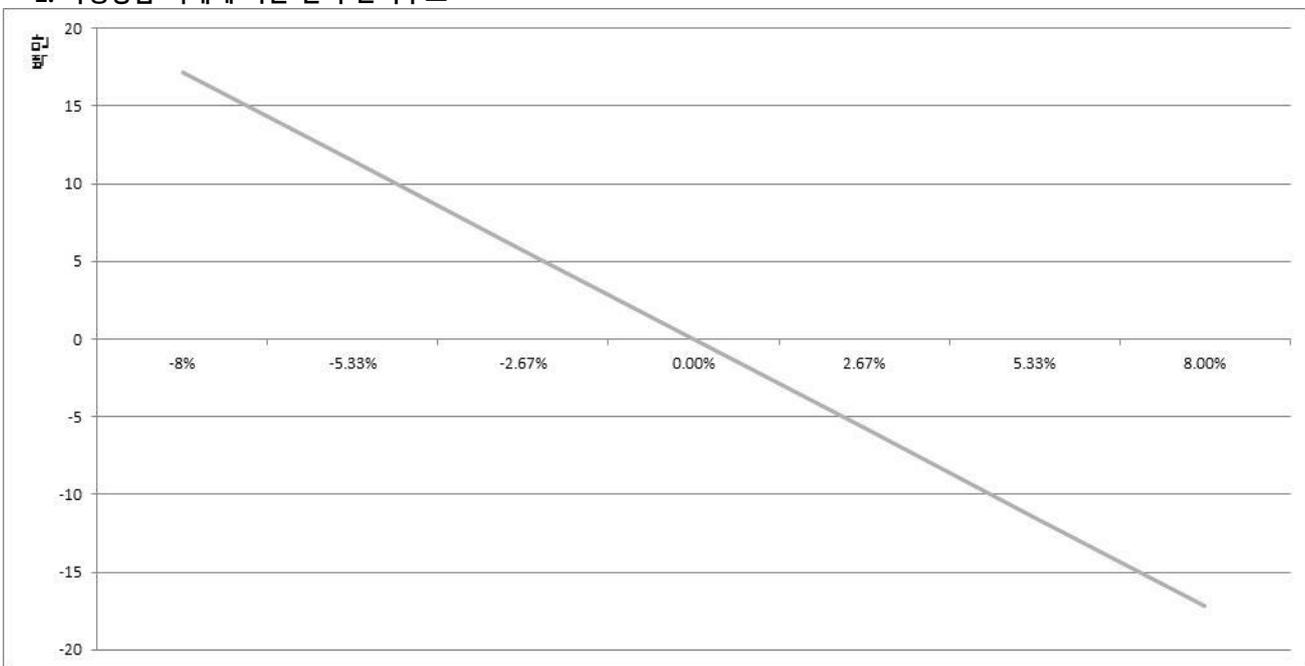
공시일: 2021-06-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	146	120	25	장내
누계	주식	주식	4,811	686	4,125	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	599	-599	장내
합계			4,811	1,285	3,526	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

315

펀드명 : 트러스트다이내믹아시아(모)

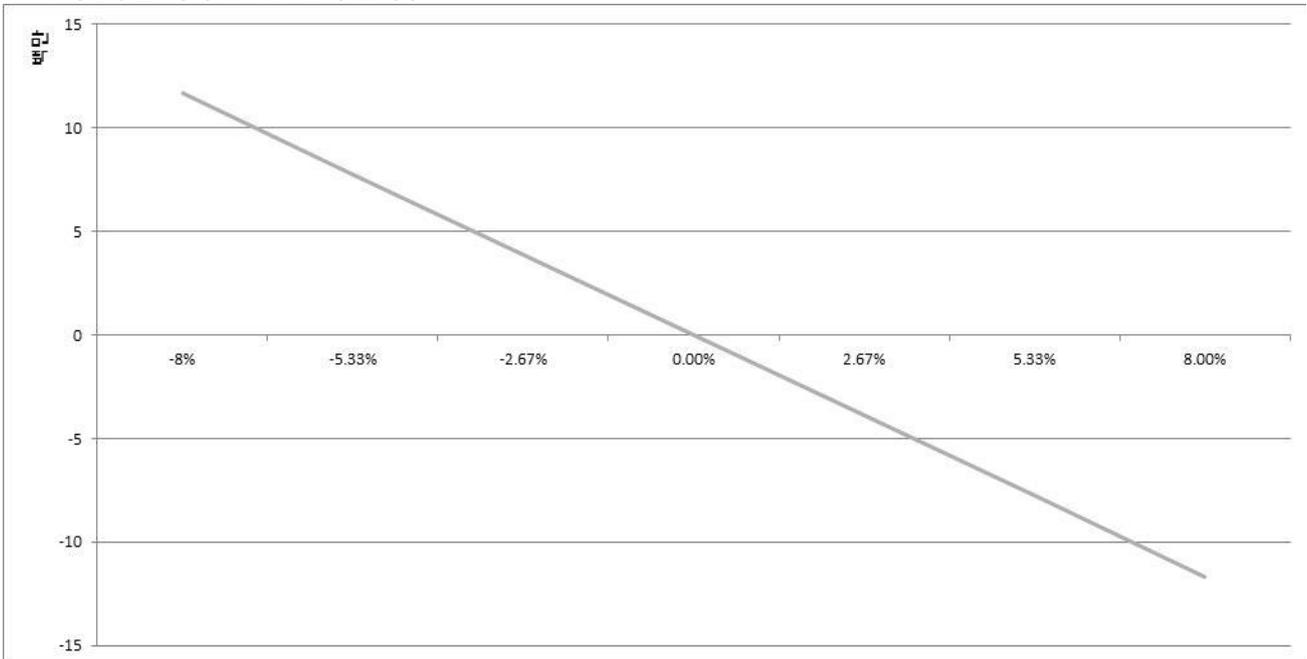
공시일: 2021-06-11

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	602	0	602	장내
신규	유가증권	선물	39	0	39	장내
누계	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	주가지수	스왑	2,956	2,956	0	장외
누계	주가지수	스왑	1,544	1,418	127	장외
합계			2,146	1,418	728	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

123