

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

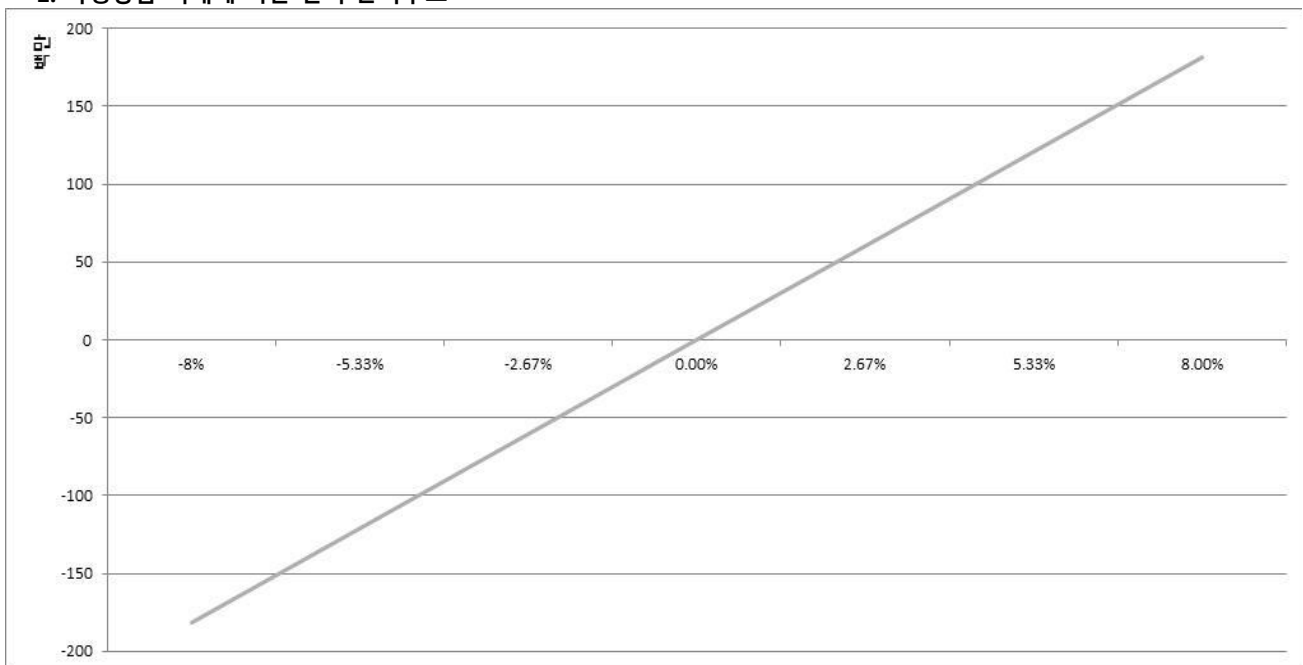
공시일: 2021-06-14

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	2,272	0	2,272	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	13,544	0	13,544	장내
합계			15,816	0	15,816	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

181

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,368

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

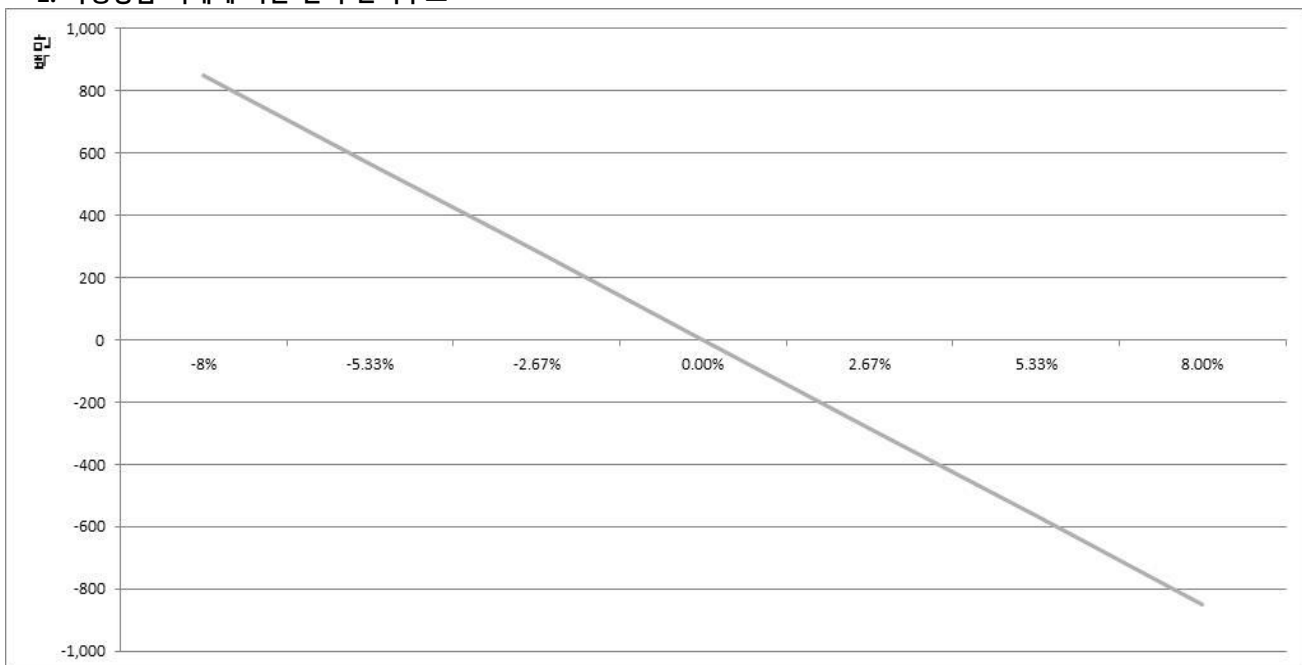
공시일: 2021-06-14

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	10,759	-10,759	장내
신규	주식	주식	47	0	47	장내
누계	주식	주식	11,033	0	11,033	장내
합계			11,033	10,759	274	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

850

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

474

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

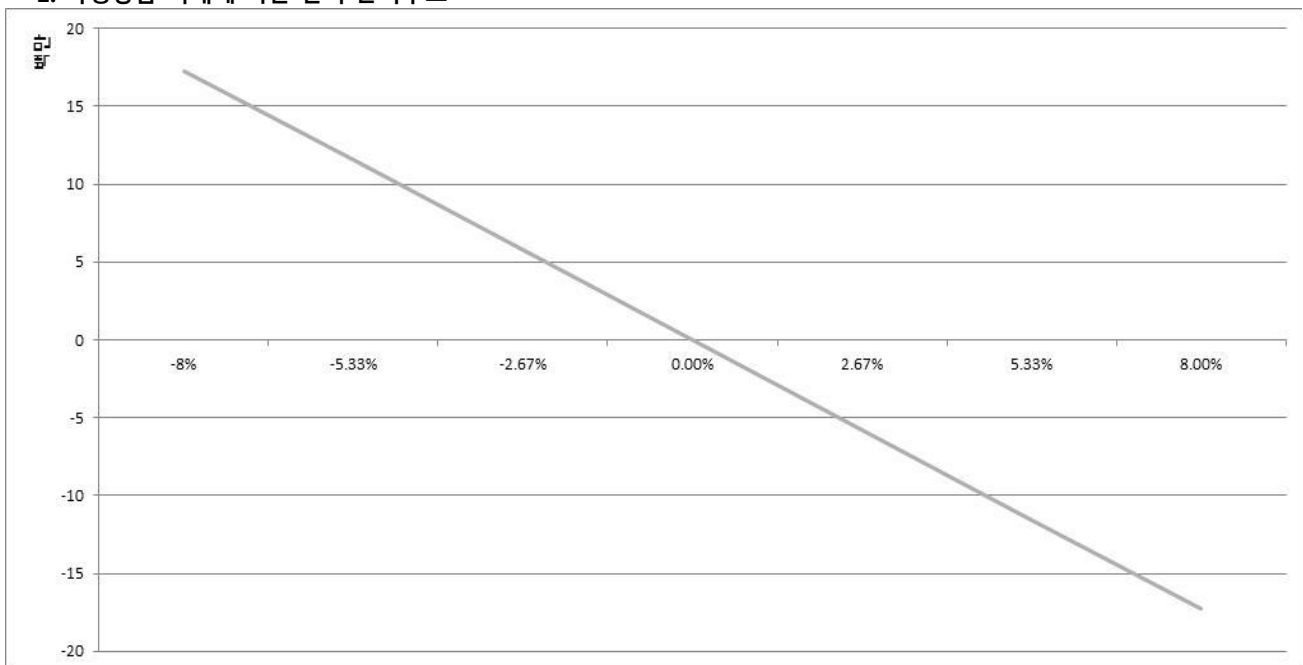
공시일: 2021-06-14

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	4,903	679	4,225	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	597	-597	장내
합계			4,903	1,276	3,628	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

320

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

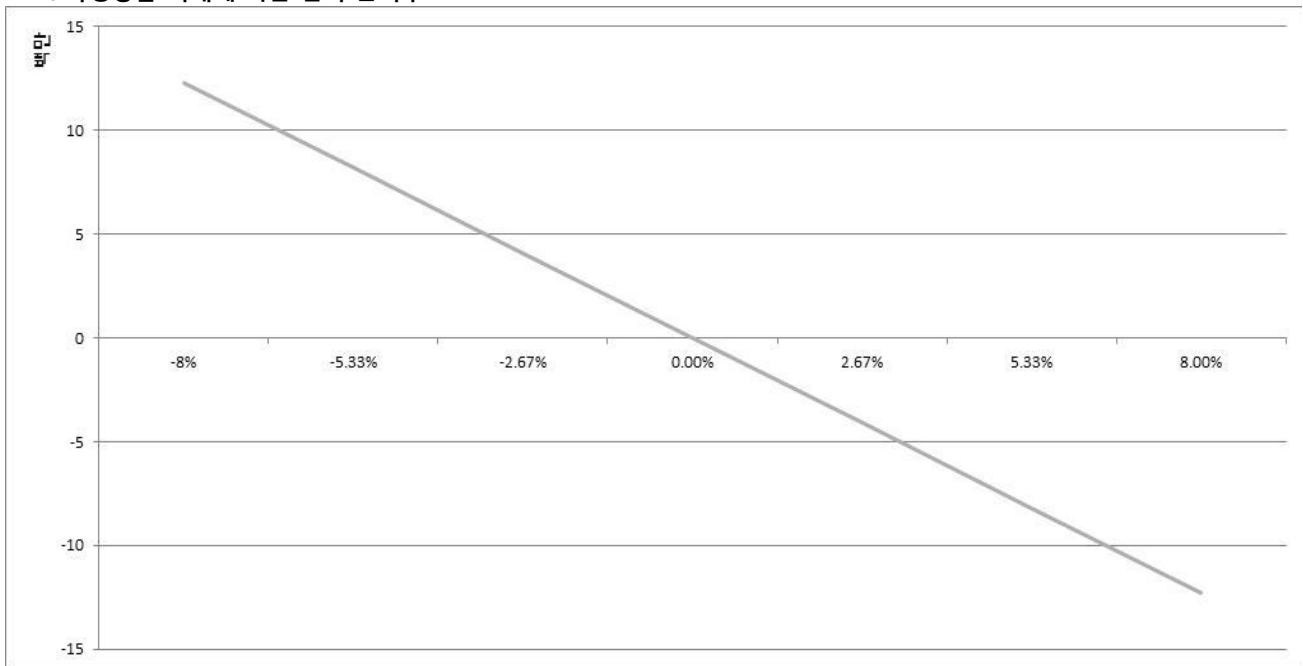
공시일: 2021-06-14

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	632	0	632	장내
신규	주가지수	스왑	0	1	-1	장외
누계	주가지수	스왑	1,534	1,422	112	장외
합계			2,166	1,422	744	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

12

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

122