

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

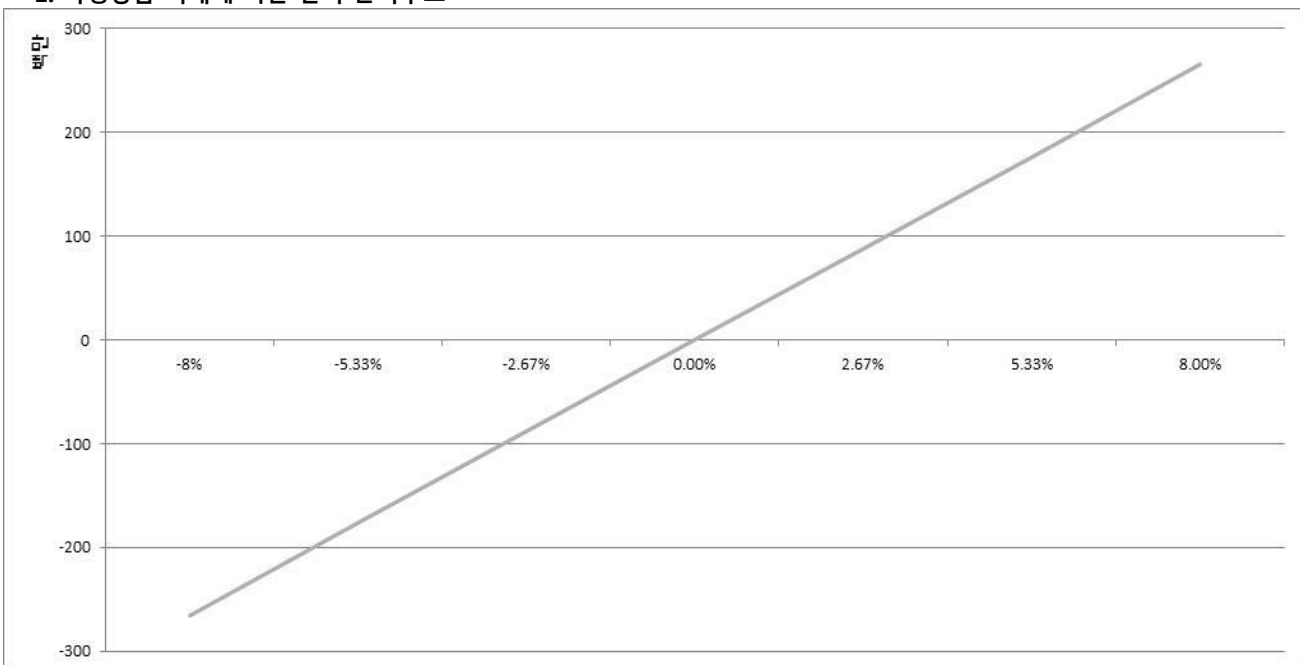
공시일: 2021-07-01

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	110	0	110	장내
신규	주식	주식	0	4	-4	장내
누계	주식	주식	9,378	0	9,378	장내
합계			9,487	0	9,487	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

9

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

902

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

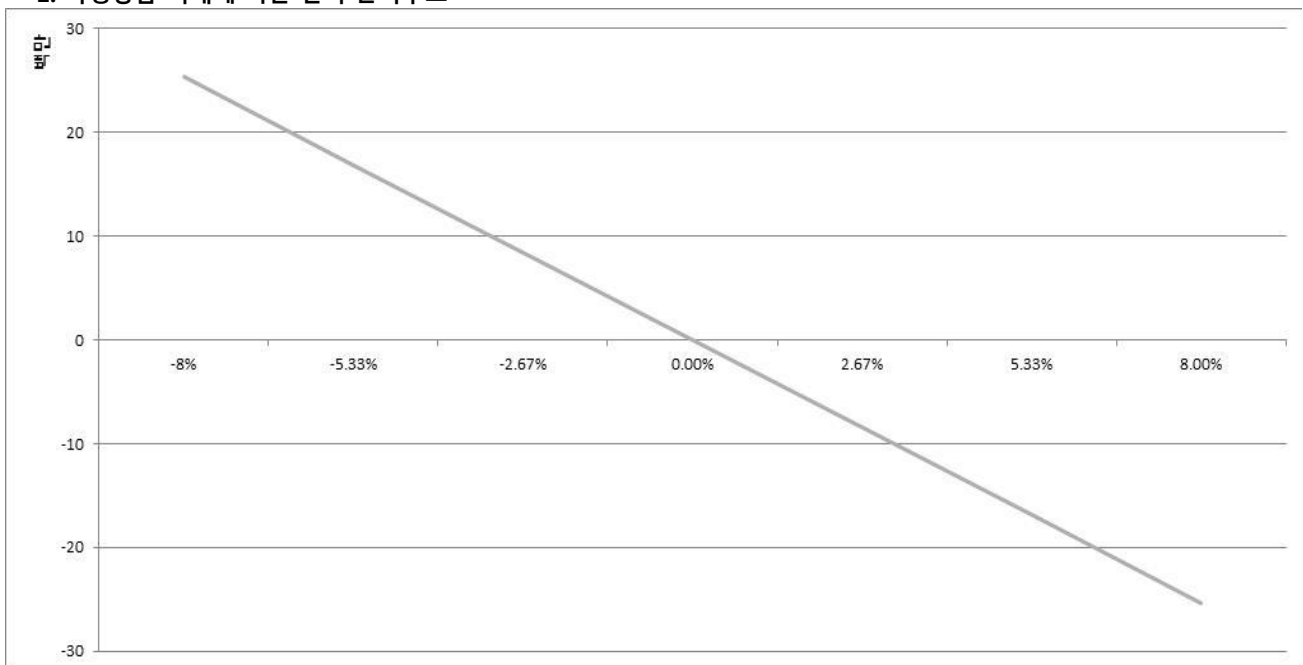
공시일: 2021-07-01

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	11,244	-11,244	장내
신규	주식	주식	58	0	58	장내
누계	주식	주식	11,427	0	11,427	장내
합계			11,427	11,244	183	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

889

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

415

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

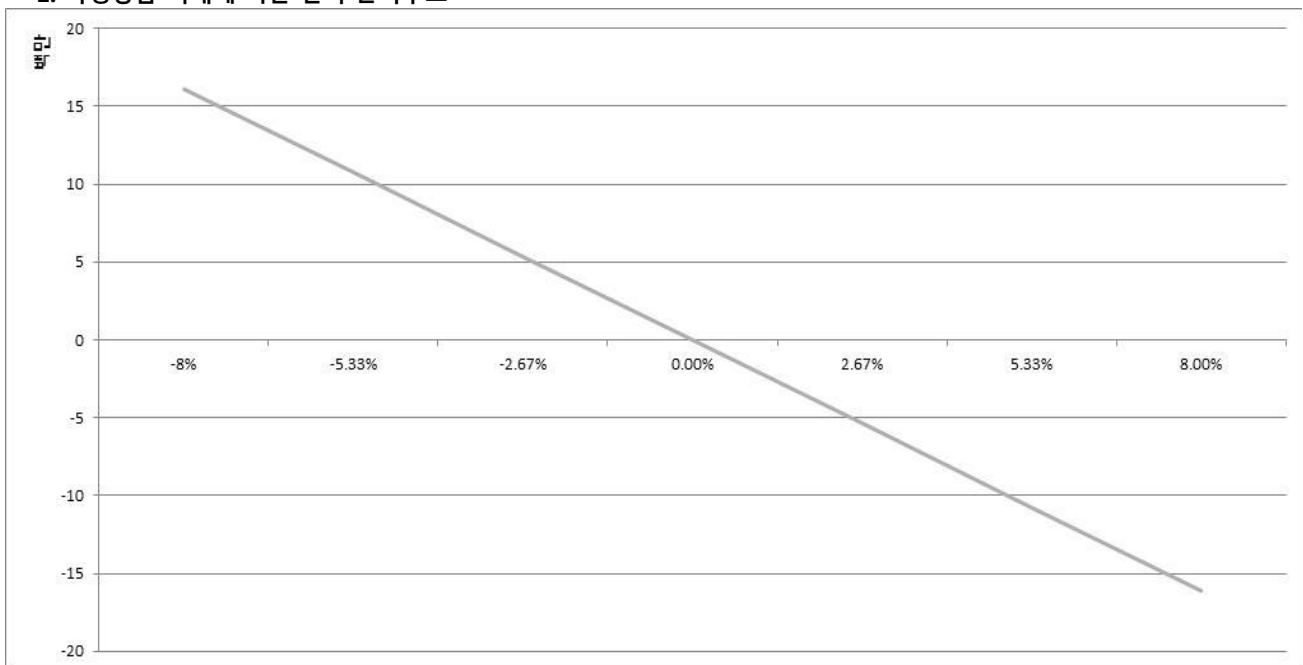
공시일: 2021-07-01

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	92	151	-59	장내
누계	주식	주식	5,246	860	4,386	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	676	-676	장내
합계			5,246	1,536	3,710	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

389

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

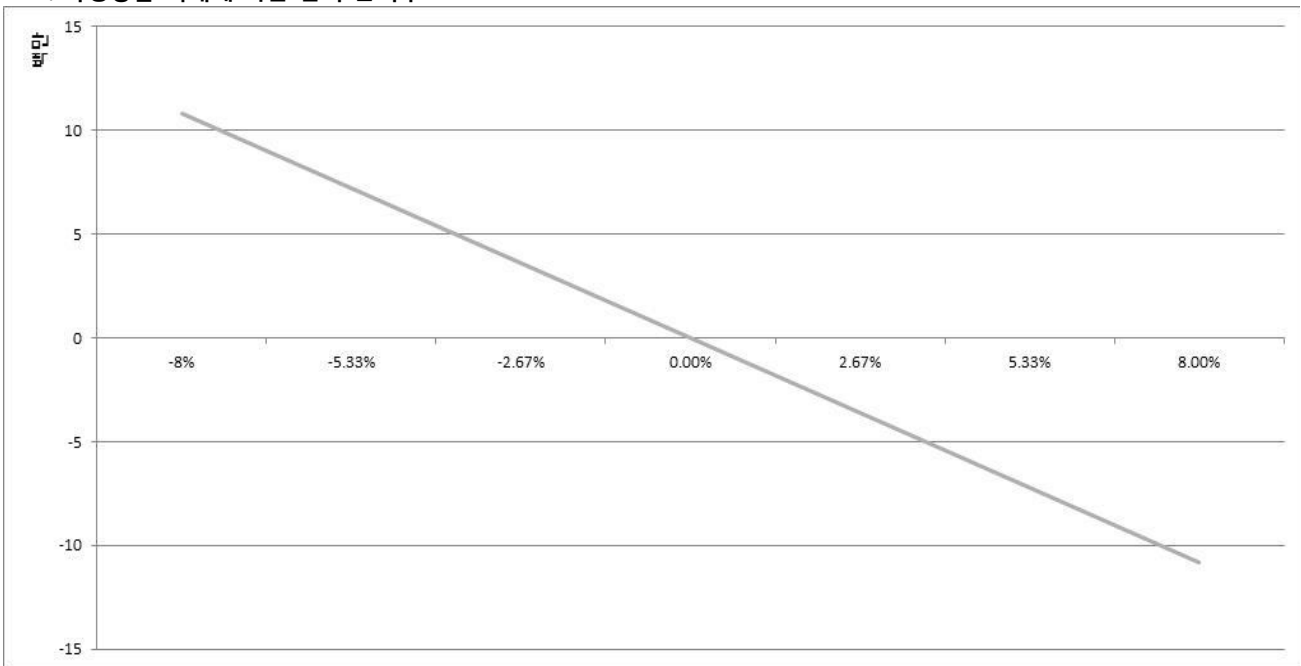
공시일: 2021-07-01

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	356	0	356	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4	0	4	장외
합계			360	0	360	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

78