

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

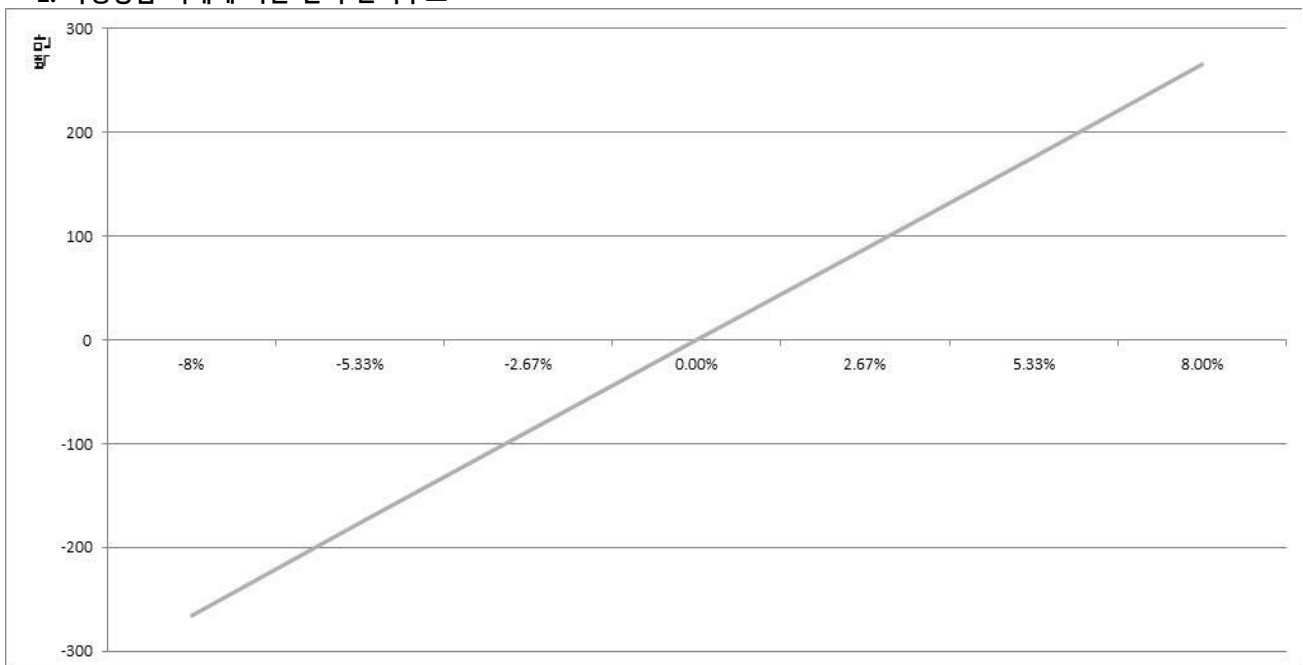
공시일: 2021-07-05

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	4,033	1,744	2,289	장내
누계	주가지수	선물	2,398	0	2,398	장내
신규	주식	주식	1,743	0	1,743	장내
누계	주식	주식	11,052	0	11,052	장내
합계			13,450	0	13,450	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

192

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,020

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

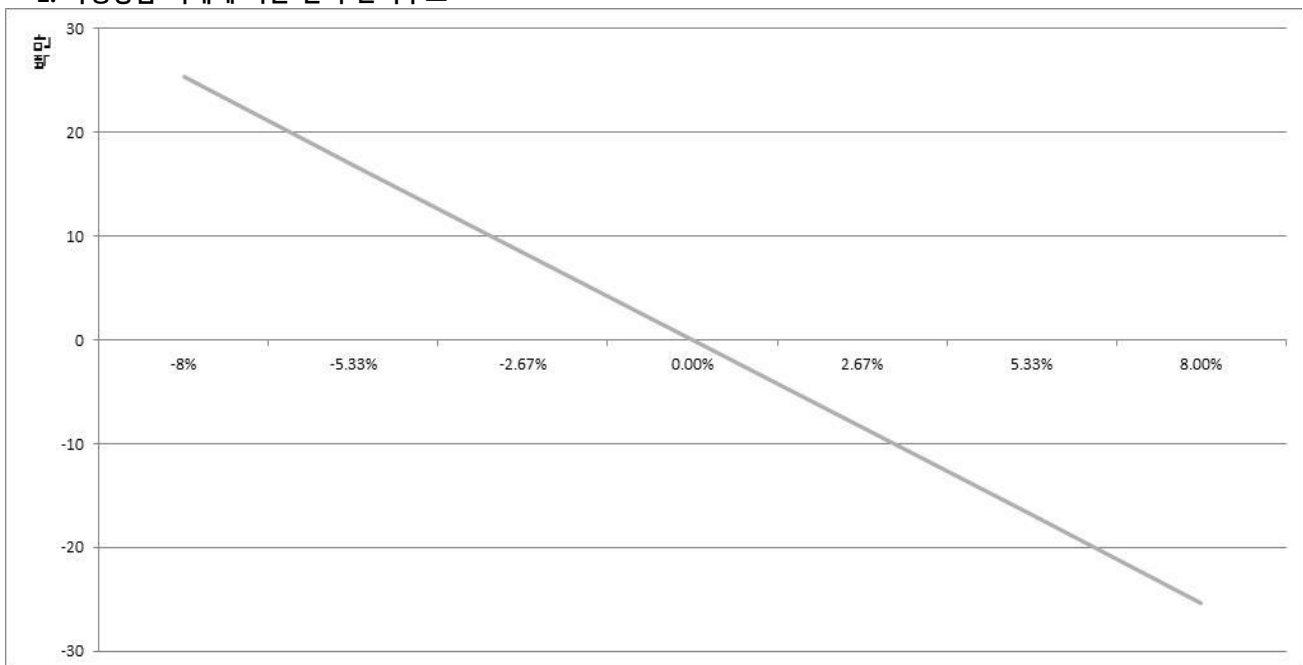
공시일: 2021-07-05

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	11,365	-11,365	장내
신규	주식	주식	75	0	75	장내
누계	주식	주식	11,753	0	11,753	장내
합계			11,753	11,365	388	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

900

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

431

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

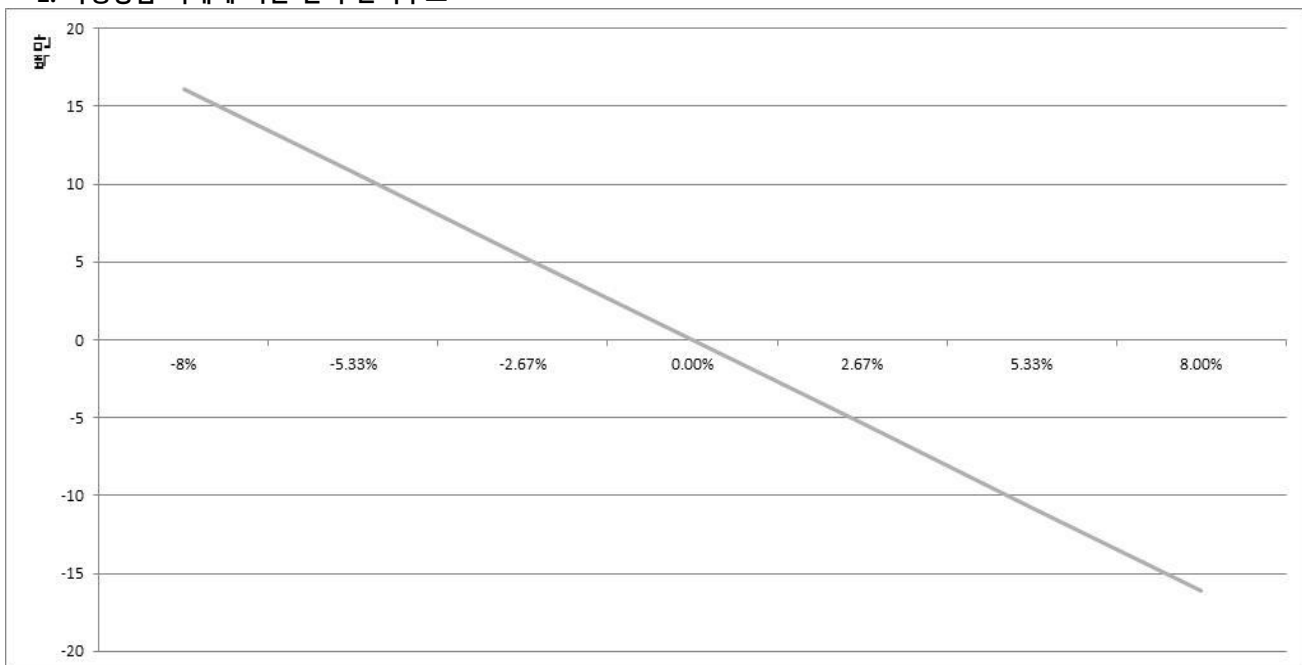
공시일: 2021-07-05

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	5,237	859	4,378	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	677	-677	장내
합계			5,237	1,536	3,701	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

384

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

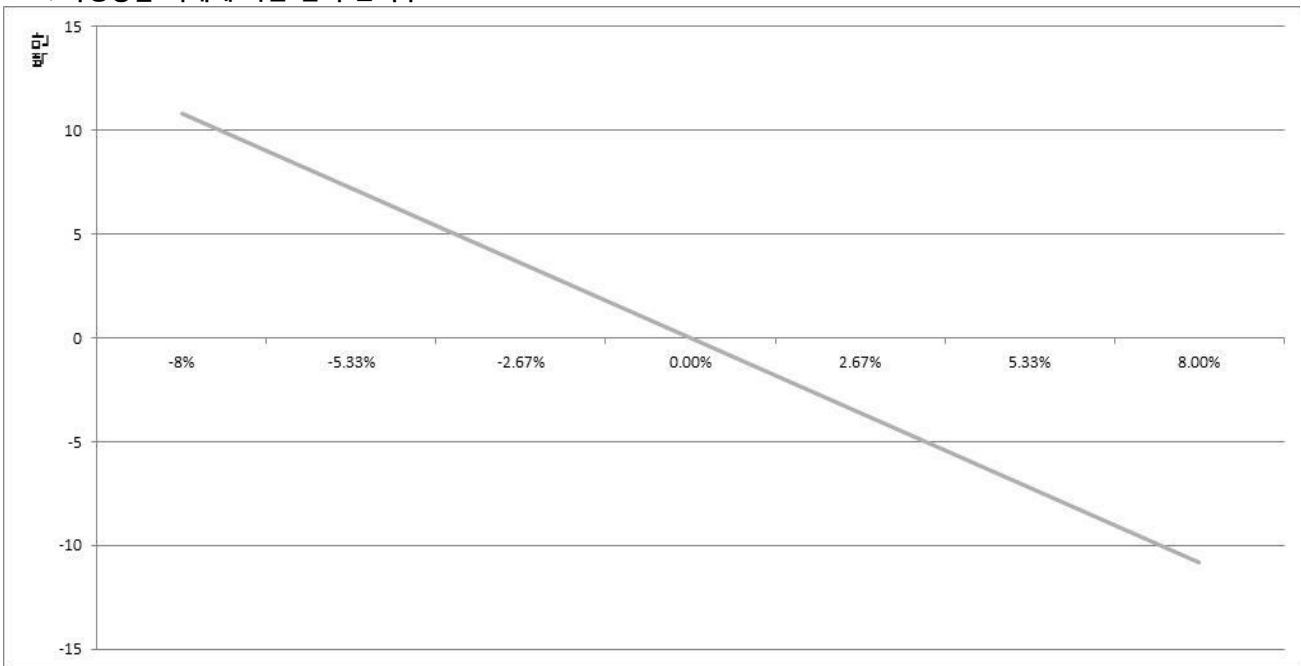
공시일: 2021-07-05

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	362	0	362	장내
신규	주가지수	스왑	0	0	0	장외
누계	주가지수	스왑	4	0	4	장외
합계			366	0	366	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

78