

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

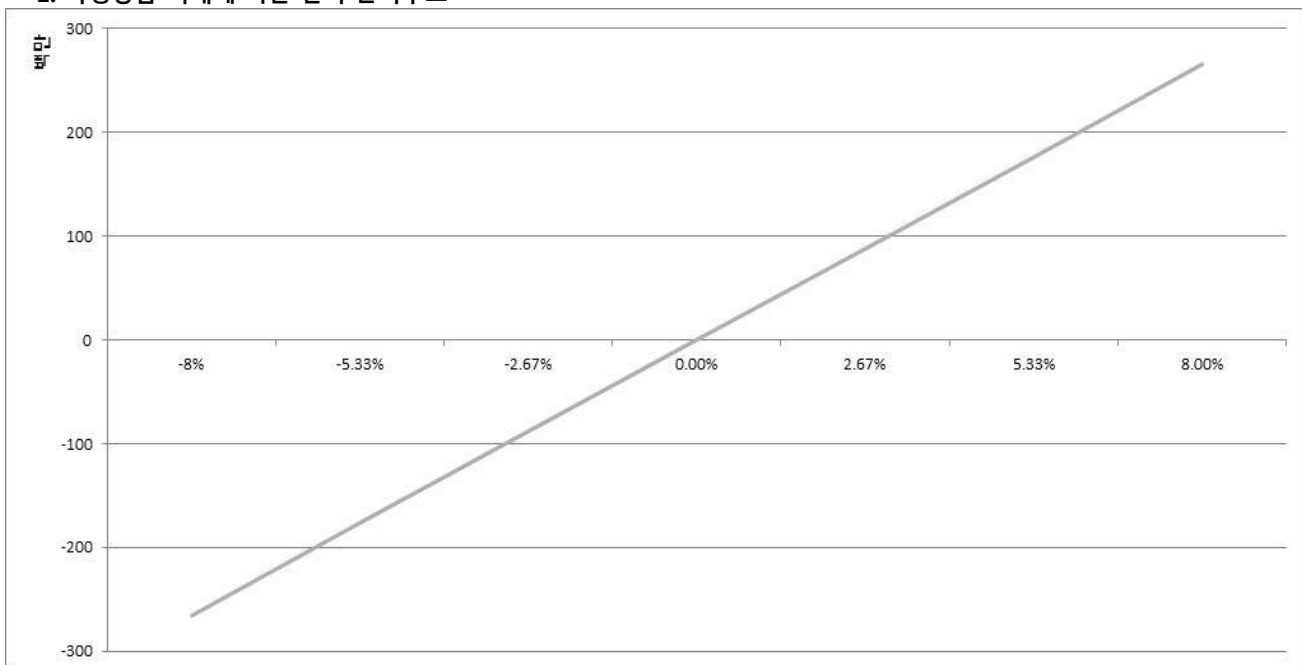
공시일: 2021-07-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	3,939	3,282	656	장내
누계	주가지수	선물	3,064	0	3,064	장내
신규	주식	주식	3,284	0	3,284	장내
누계	주식	주식	14,379	0	14,379	장내
합계			17,443	0	17,443	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

245

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,178

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

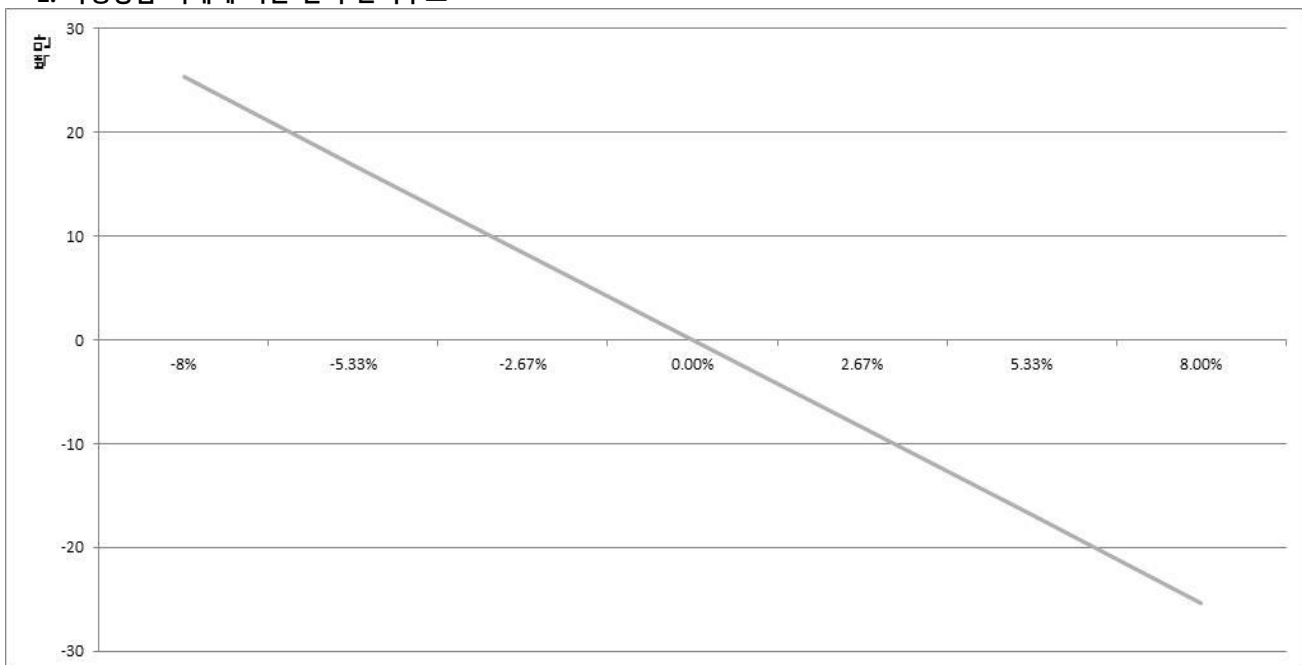
공시일: 2021-07-06

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	11,524	-11,524	장내
신규	주식	주식	35	17	18	장내
누계	주식	주식	11,960	0	11,960	장내
합계			11,960	11,524	437	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

913

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

438

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

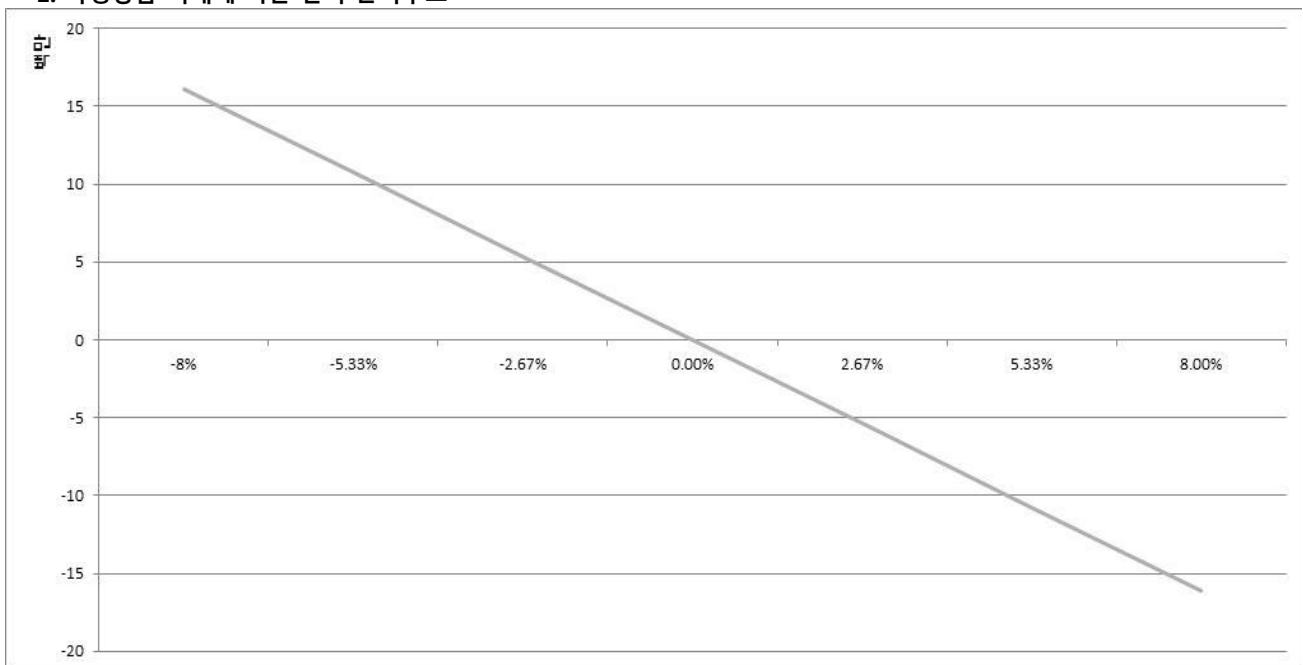
공시일: 2021-07-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	10	34	-24	장내
누계	주식	주식	5,236	852	4,383	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	679	-679	장내
합계			5,236	1,532	3,704	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

383

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

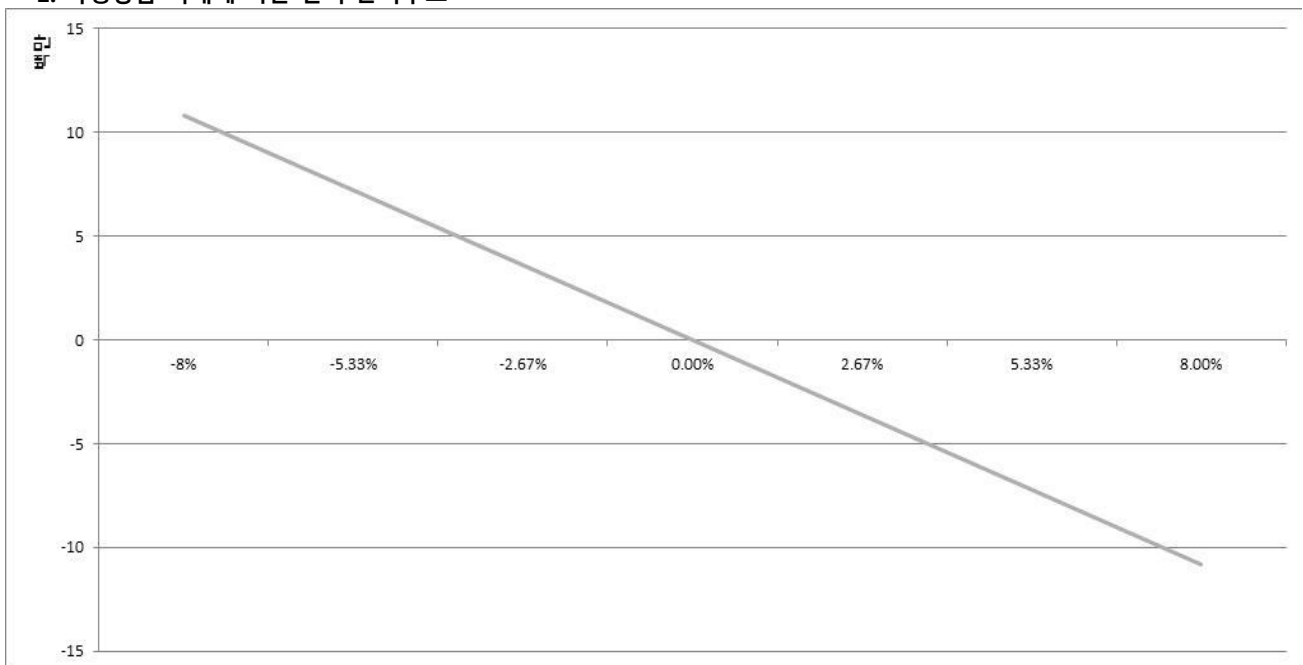
공시일: 2021-07-06

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	0	2	-2	장내
누계	주식	주식	359	0	359	장내
신규	주가지수	스왑	0	4	-4	장외
누계	주가지수	스왑	0	0	0	장외
합계			359	0	359	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

77