

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

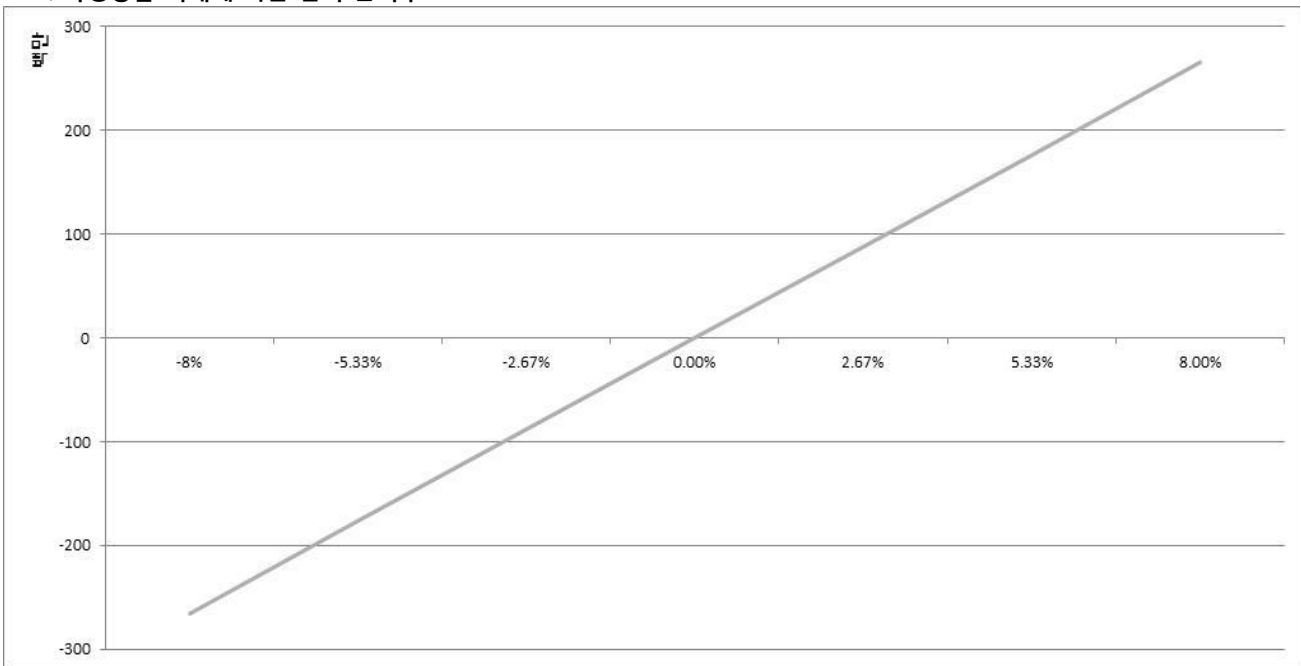
공시일: 2021-07-07

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	3,077	0	3,077	장내
신규	주식	주식	3	2	1	장내
누계	주식	주식	14,446	0	14,446	장내
합계			17,522	0	17,522	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

246

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,179

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

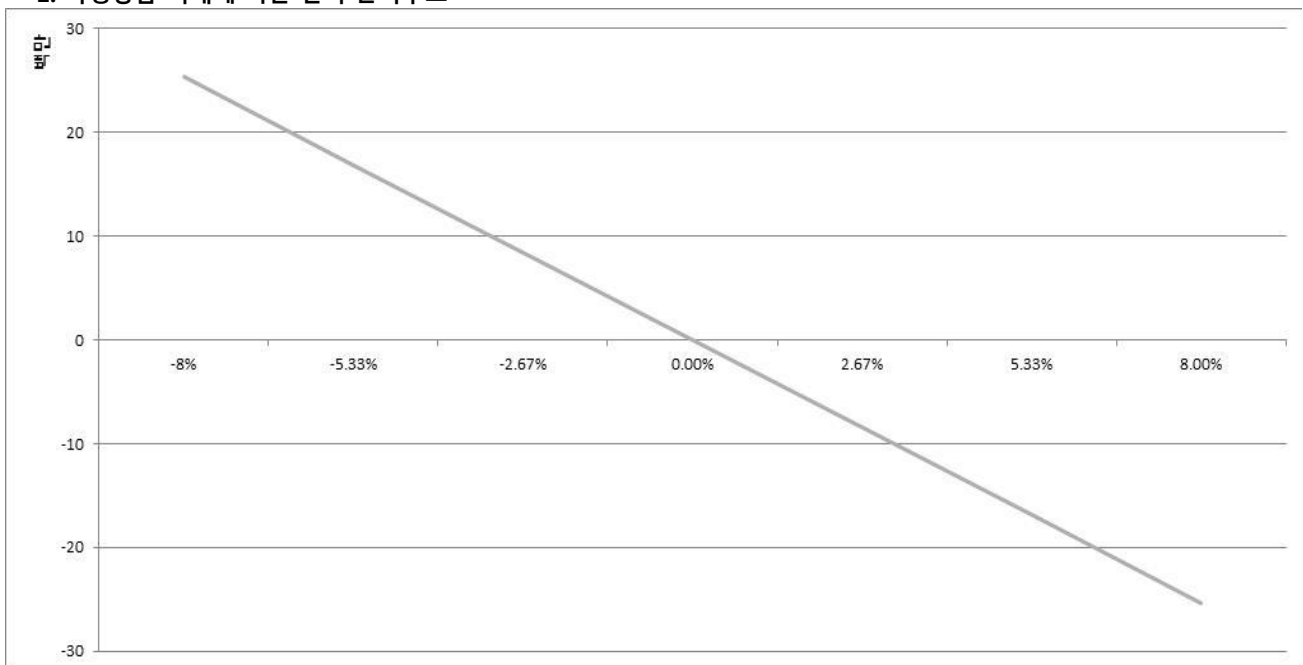
공시일: 2021-07-07

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	11,409	-11,409	장내
신규	주식	주식	52	0	52	장내
누계	주식	주식	11,843	0	11,843	장내
합계			11,843	11,409	433	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

905

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

431

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

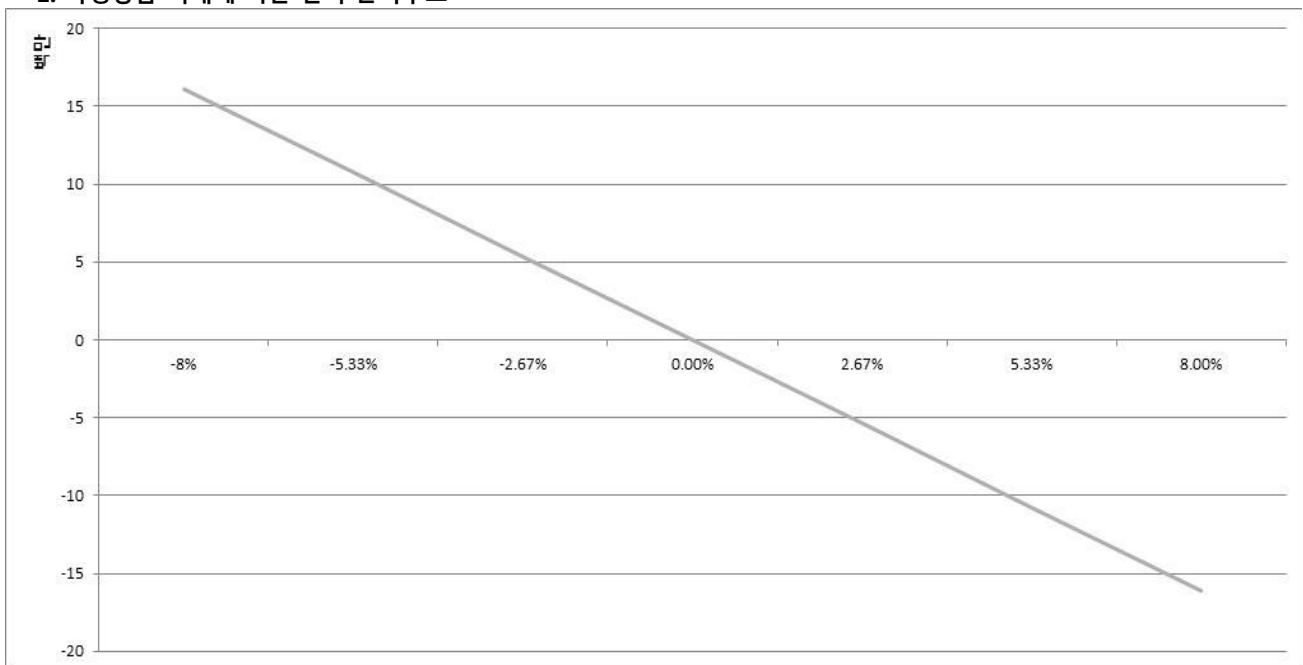
공시일: 2021-07-07

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	5,248	874	4,373	장내
신규	유가증권	선물	0	59	-59	장내
누계	유가증권	선물	0	735	-735	장내
합계			5,248	1,609	3,638	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

380

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

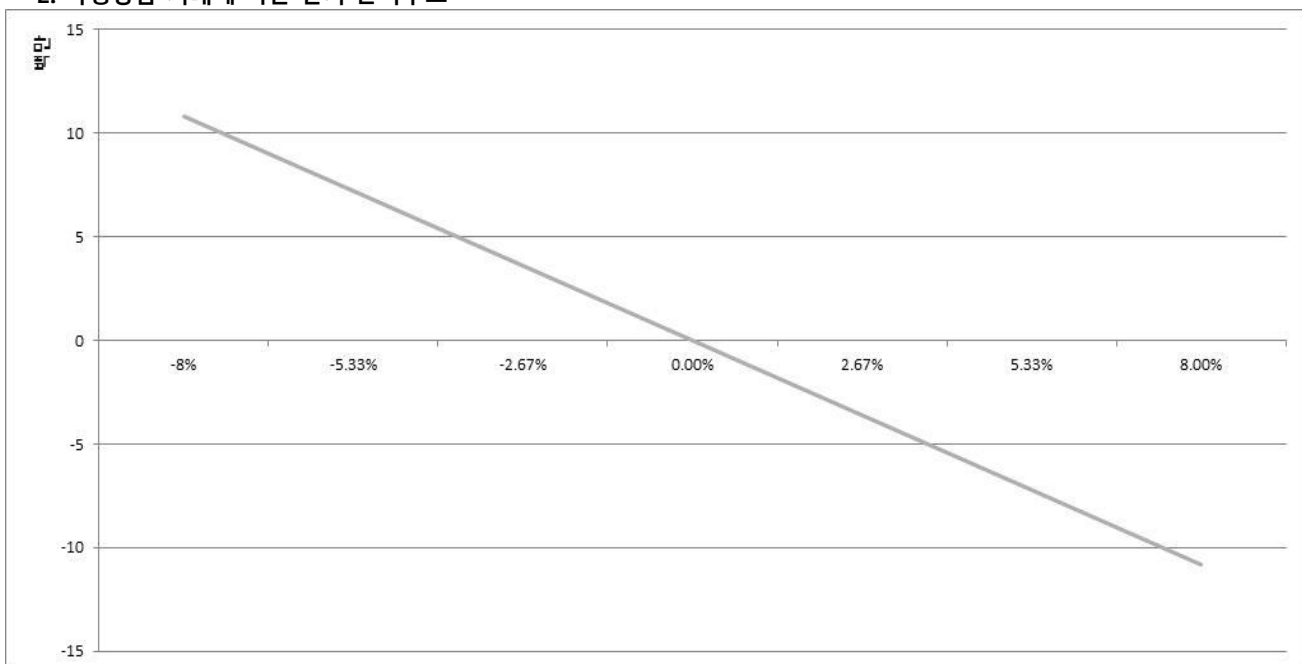
공시일: 2021-07-07

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	373	0	373	장내
합계			373	0	373	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

80