

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

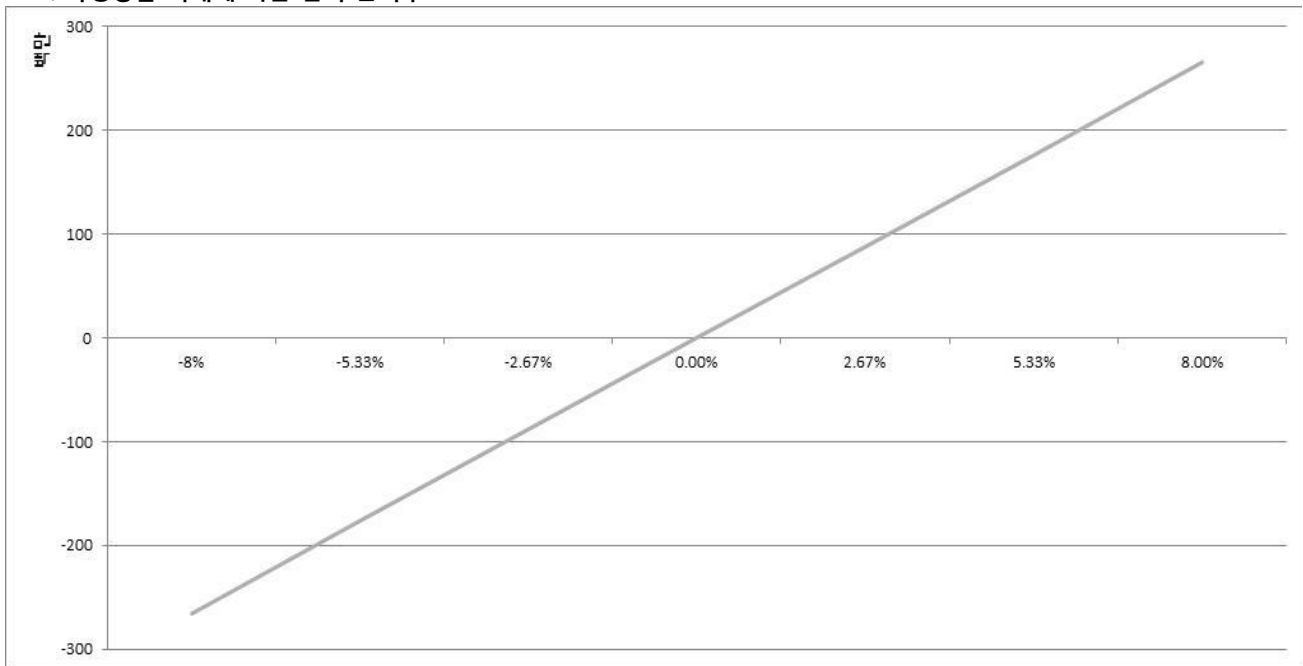
공시일: 2021-07-09

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	3,028	0	3,028	장내
신규	주식	주식	1	0	1	장내
누계	주식	주식	14,221	0	14,221	장내
합계			17,249	0	17,249	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

241

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,171

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

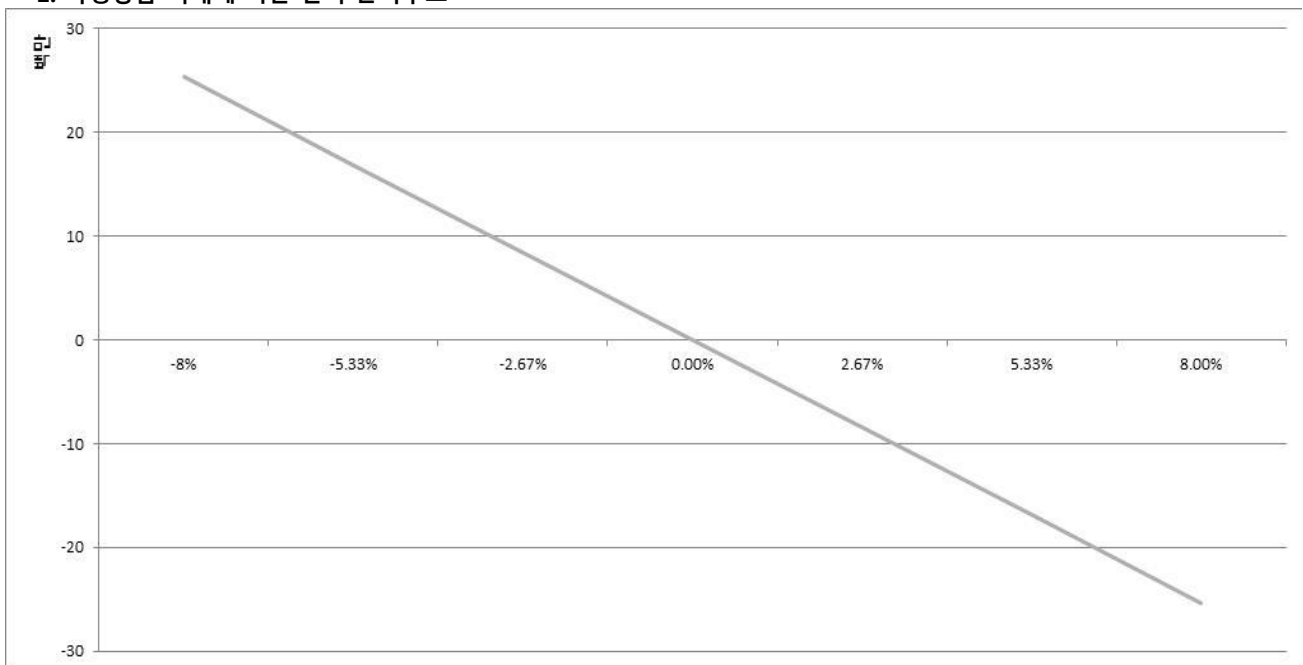
공시일: 2021-07-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	147	-147	장내
누계	주가지수	선물	0	11,861	-11,861	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,410	0	11,410	장내
합계			11,410	11,861	-452	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

937

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

433

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

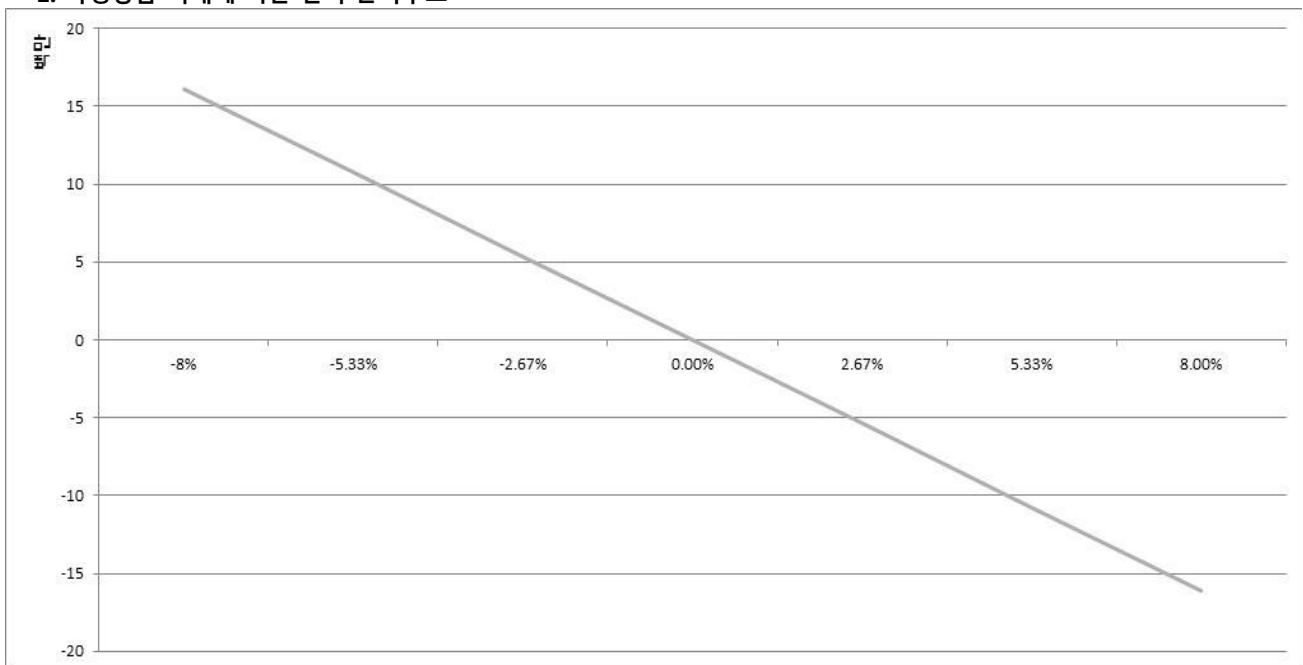
공시일: 2021-07-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	134	0	134	장내
누계	주식	주식	5,320	852	4,468	장내
신규	유가증권	선물	0	117	-117	장내
누계	유가증권	선물	0	969	-969	장내
합계			5,320	1,821	3,499	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

19

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

378

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

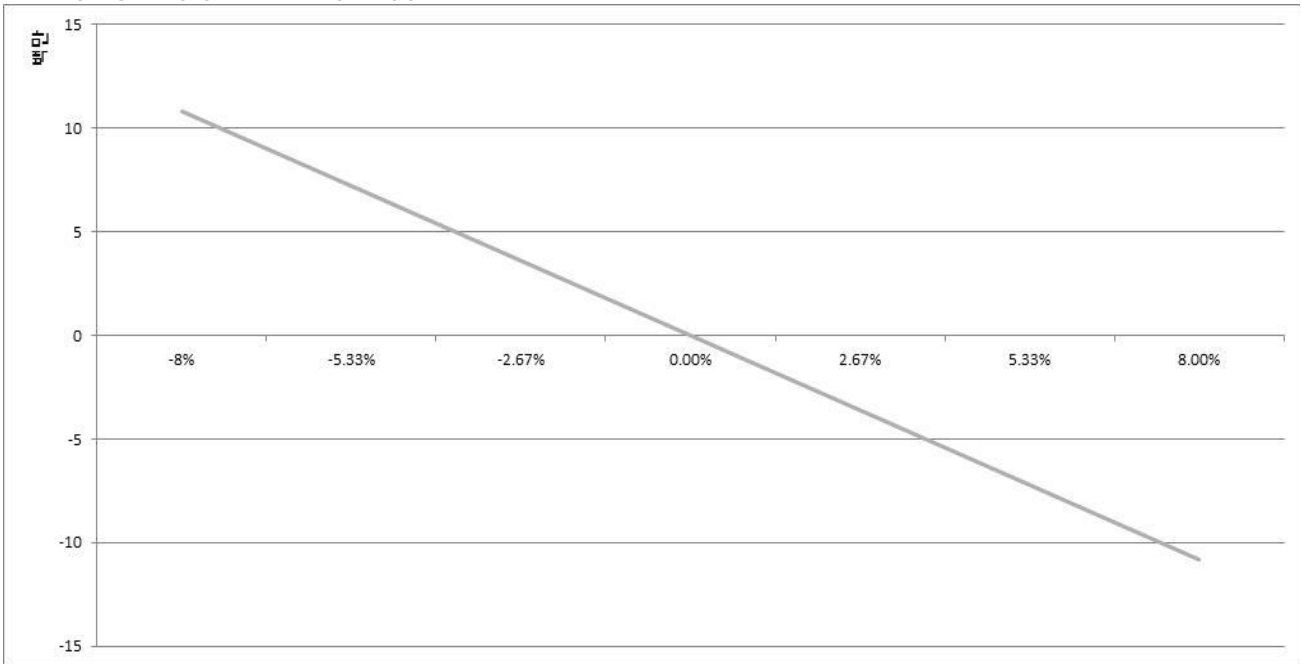
공시일: 2021-07-09

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	397	0	397	장내
합계			397	0	397	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

85