

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

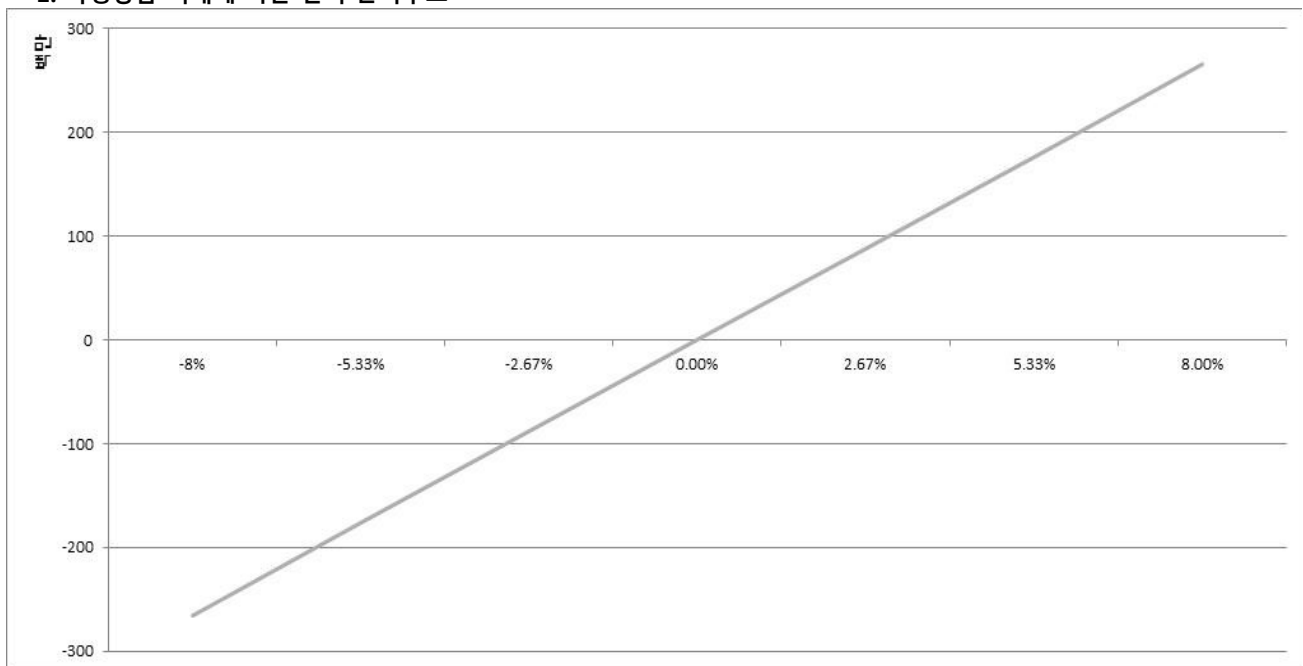
공시일: 2021-08-10

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	15,216	0	15,216	장내
신규	주식	주식	1	1	0	장내
누계	주식	주식	16,565	0	16,565	장내
합계			31,781	0	31,781	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,218

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,101

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

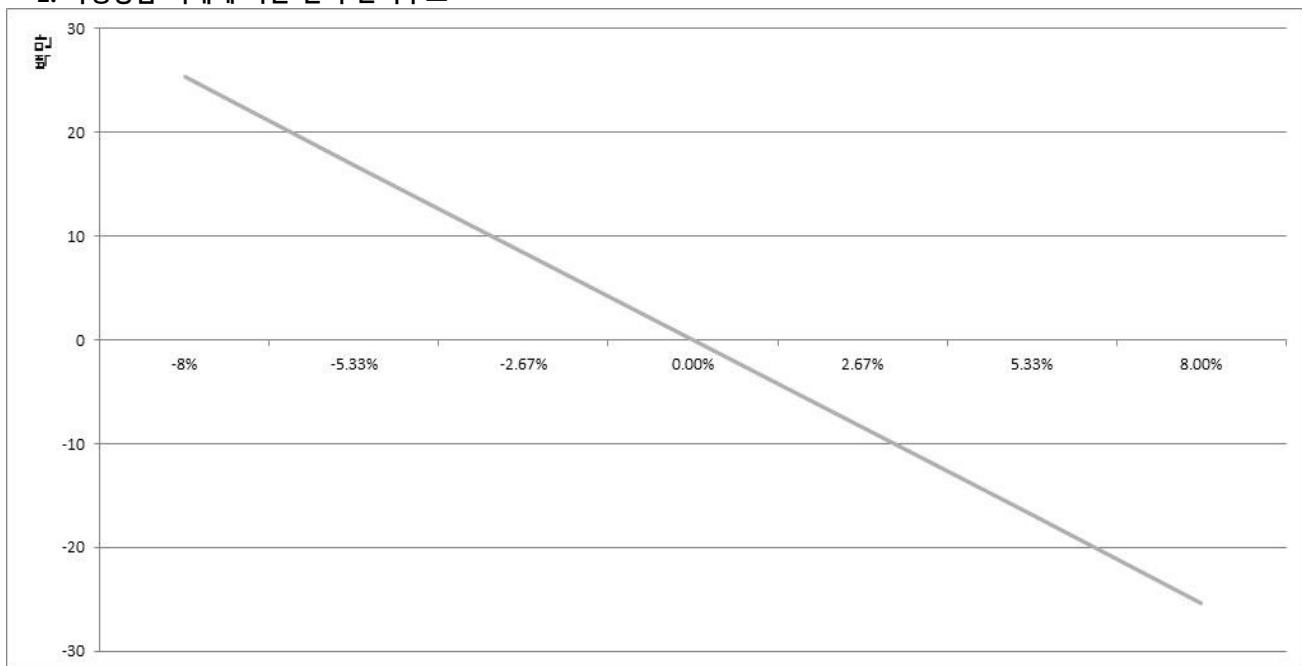
공시일: 2021-08-10

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	12,140	-12,140	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,171	0	11,171	장내
합계			11,171	12,140	-969	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

963

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

388

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

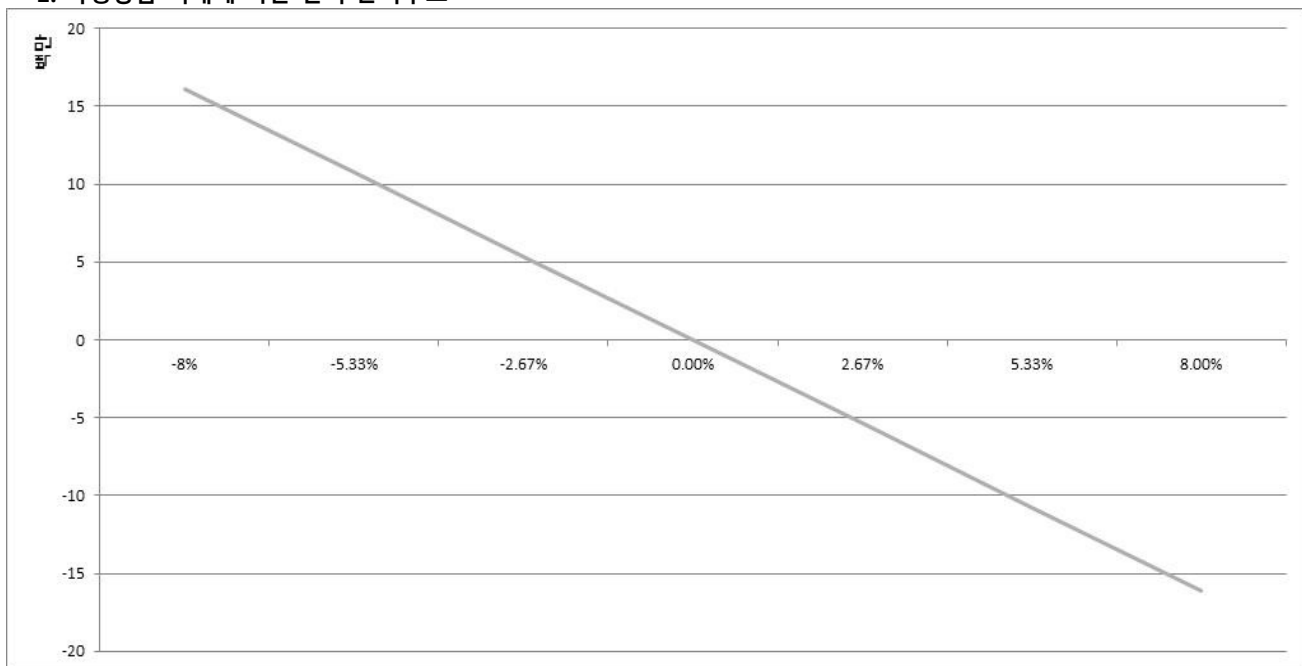
공시일: 2021-08-10

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	4,502	1,104	3,398	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	522	-522	장내
합계			4,502	1,626	2,876	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

338