

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

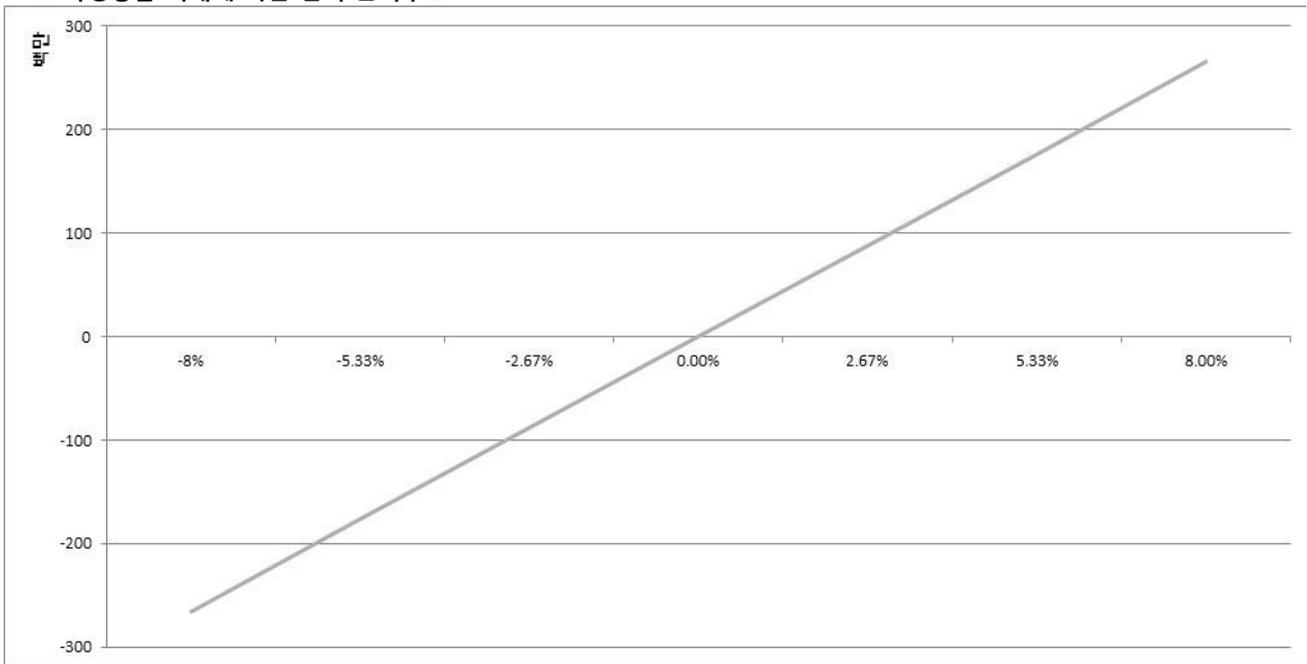
공시일: 2021-08-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	536	0	536	장내
누계	주가지수	선물	15,642	0	15,642	장내
신규	주식	주식	20	0	20	장내
누계	주식	주식	16,472	0	16,472	장내
합계			32,114	0	32,114	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,253

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,124

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

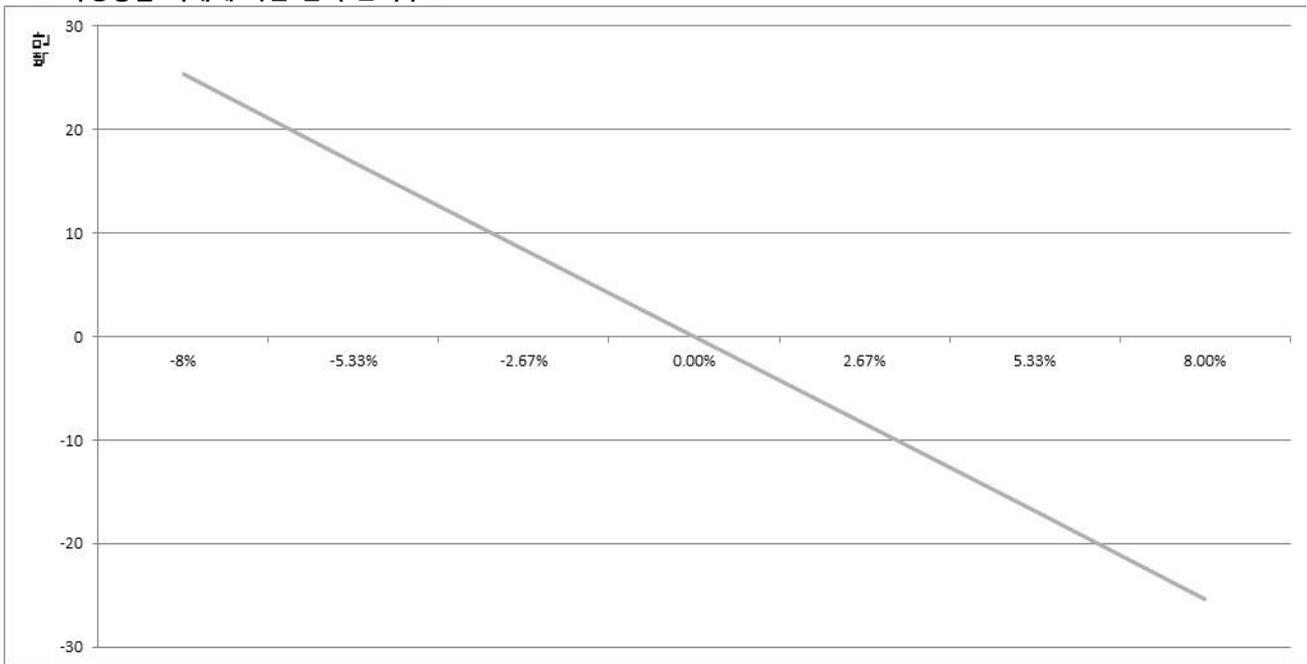
공시일: 2021-08-11

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	12,051	-12,051	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	11,112	0	11,112	장내
합계			11,112	12,051	-939	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

953

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

384

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

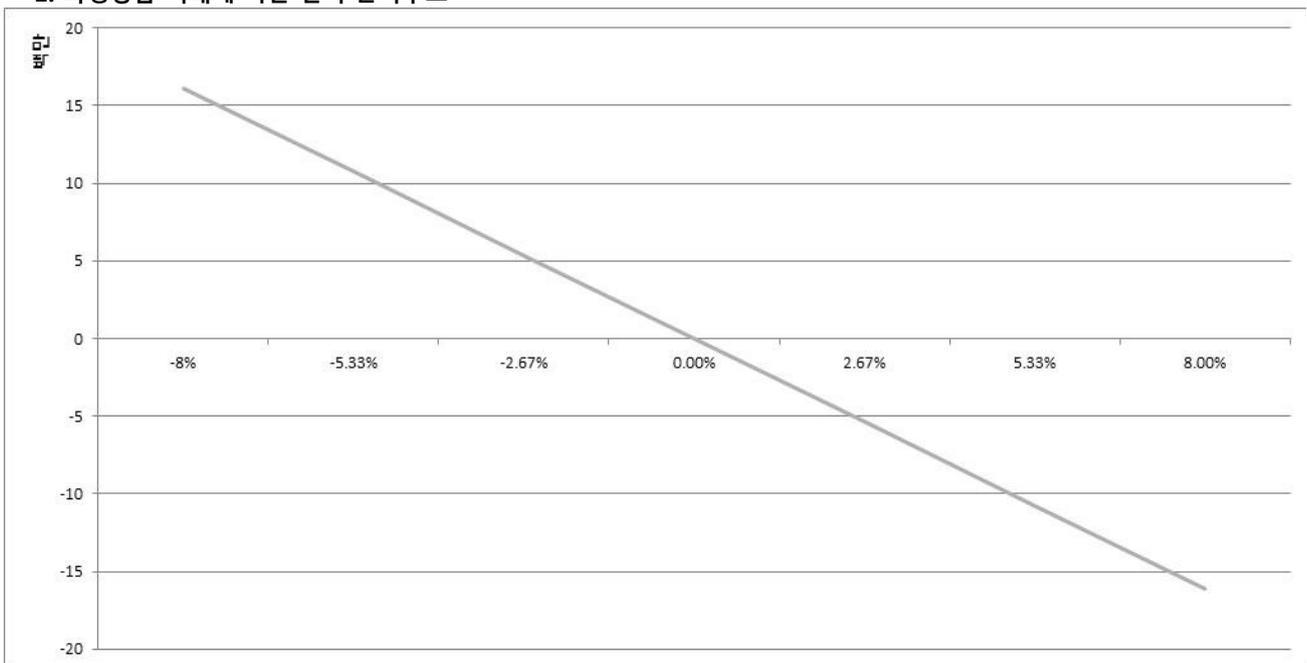
공시일: 2021-08-11

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	4,471	1,099	3,373	장내
신규	유가증권	선물	524	524	0	장내
누계	유가증권	선물	0	524	-524	장내
합계			4,471	1,623	2,849	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

334