

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

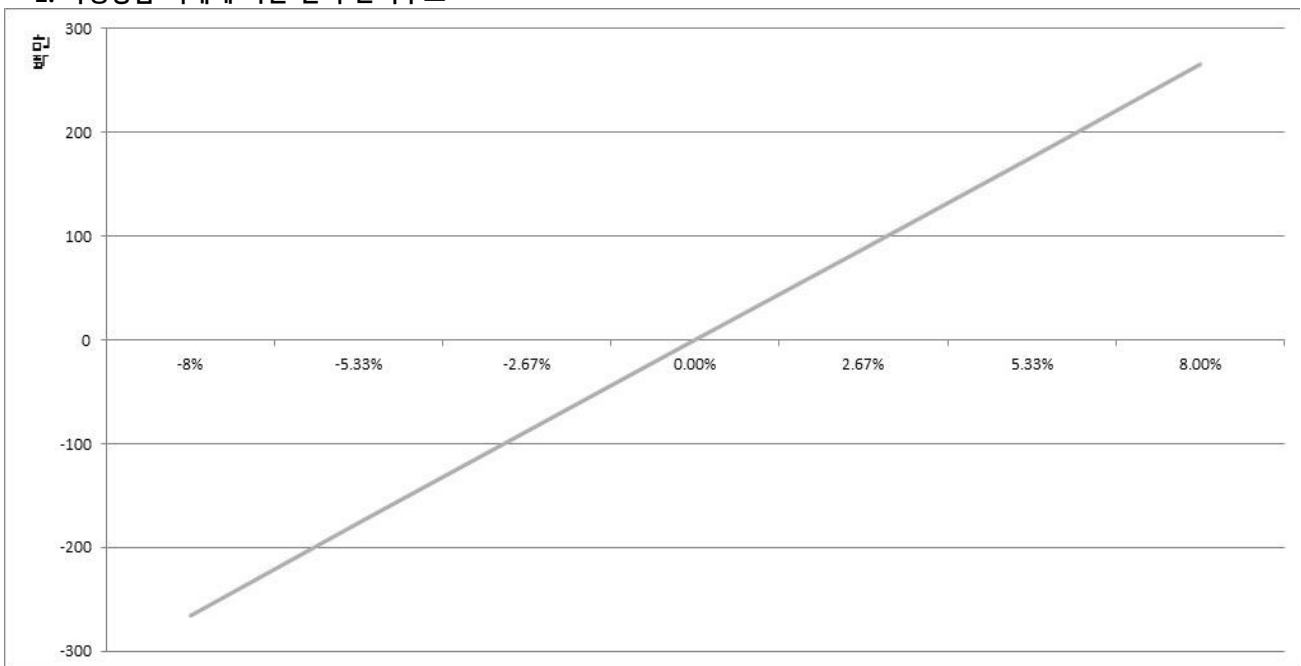
공시일: 2021-08-23

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	18,235	0	18,235	장내
신규	주식	주식	42	4	38	장내
누계	주식	주식	23,506	0	23,506	장내
합계			41,741	0	41,741	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,459

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,775

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

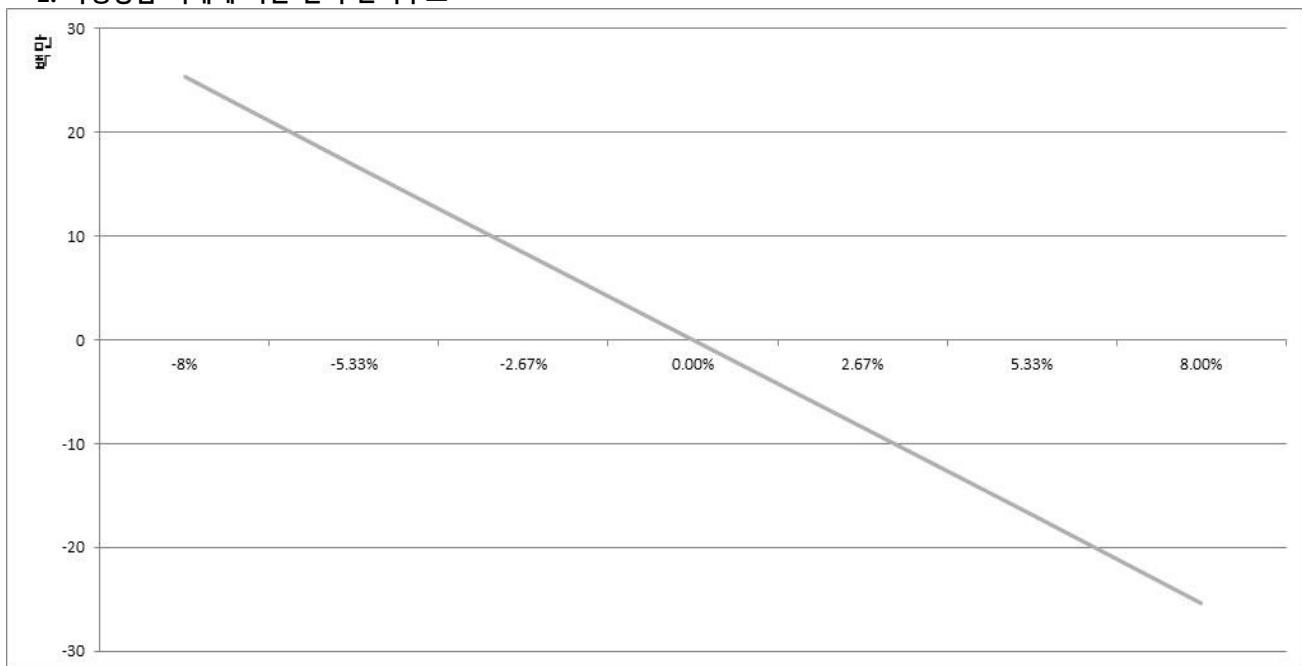
공시일: 2021-08-23

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	11,363	-11,363	장내
신규	주식	주식	10	0	10	장내
누계	주식	주식	12,820	0	12,820	장내
합계			12,820	11,363	1,457	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

903

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

452

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

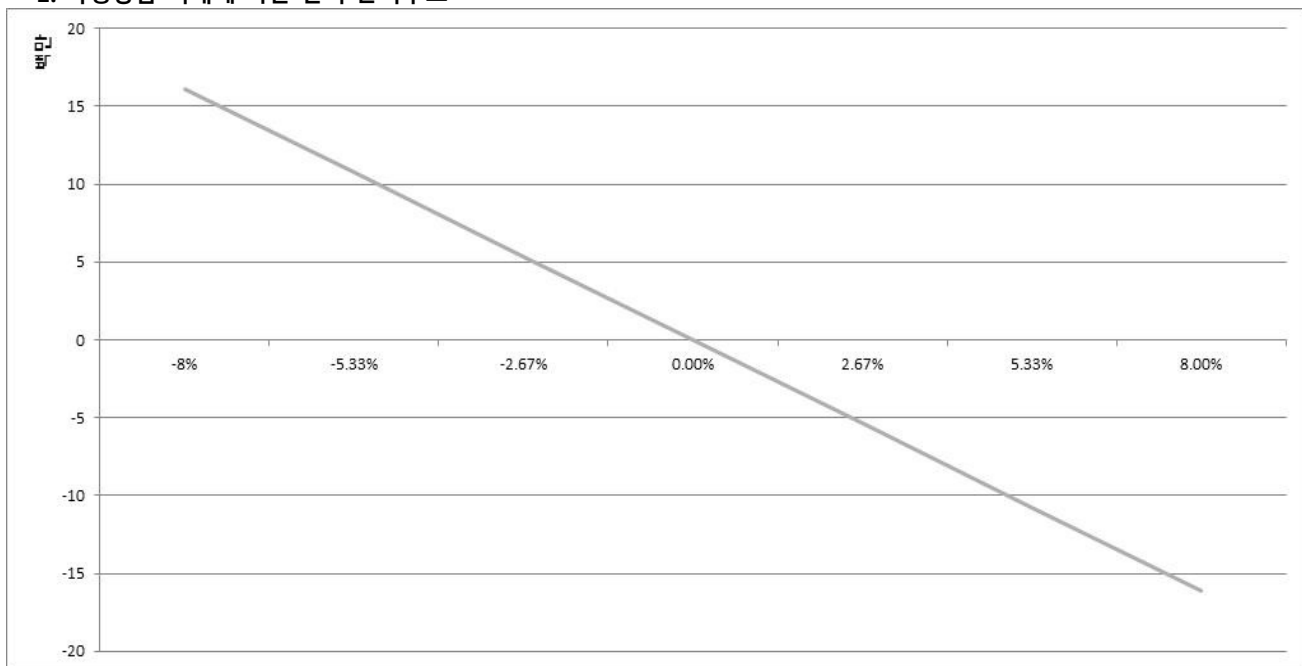
공시일: 2021-08-23

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	207	176	31	장내
누계	주식	주식	3,965	1,027	2,938	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	479	-479	장내
합계			3,965	1,506	2,459	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

246