

## 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

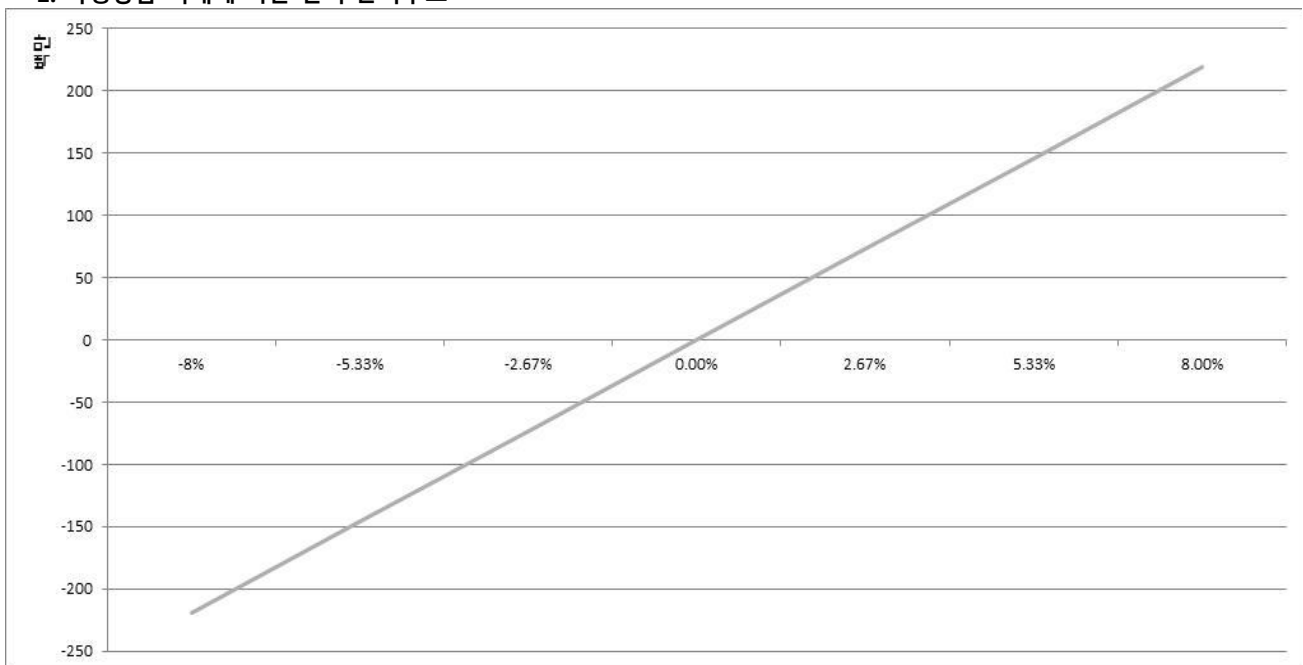
공시일: 2021-05-24

### 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   | 2,744  | 0     | 2,744     | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 2      | 0     | 2         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 11,756 | 0     | 11,756    | 장내 |
| 합계 |      |      | 14,500 | 0     | 14,500    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

219

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,348

## 펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

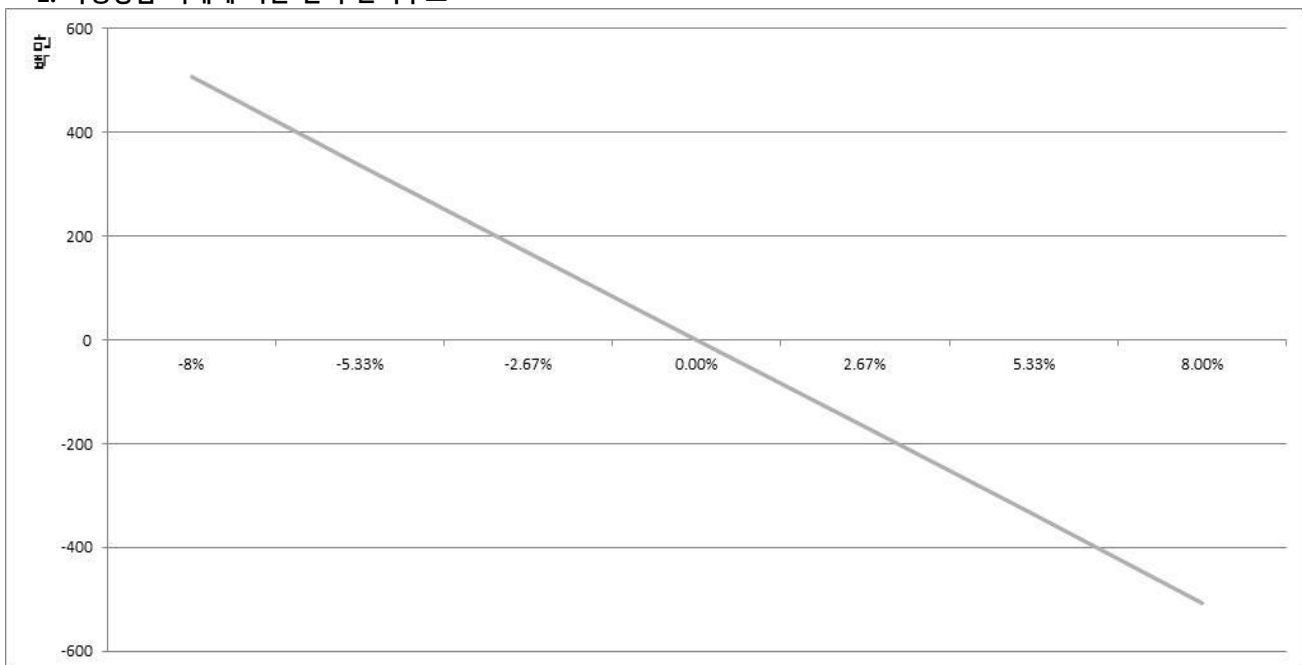
공시일: 2021-05-24

### 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     | 6,352 | -6,352    | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 6,370 | 0     | 6,370     | 장내 |
| 합계 |      |      | 6,370 | 6,352 | 18        |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

506

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

386

## 펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

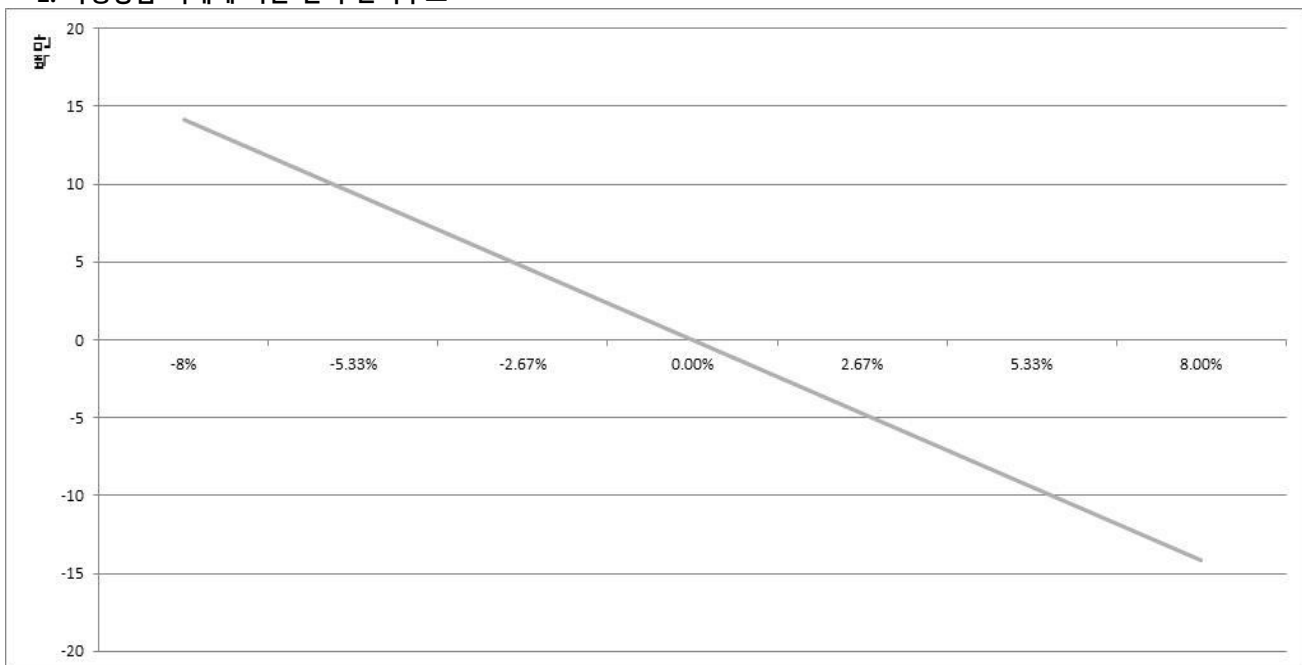
공시일: 2021-05-24

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식   | 주식   | 208   | 629   | -422      | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 4,540 | 781   | 3,758     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 655   | -655      | 장내 |
| 합계 |      |      | 4,540 | 1,437 | 3,103     |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

14

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

276

## 펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

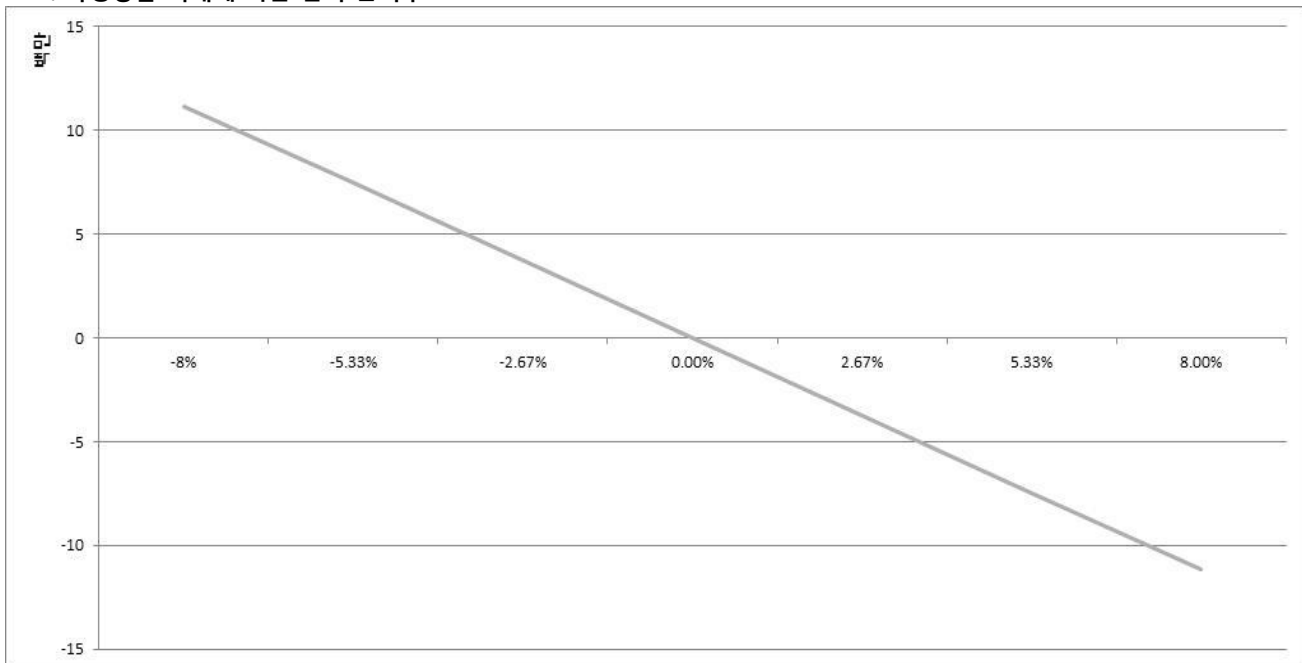
공시일: 2021-05-24

### 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   | 602   | 0     | 602       | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 40    | -40       | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 0     | 0     | 0         | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 1,514 | 1,399 | 115       | 장외 |
| 합계 |      |      | 2,116 | 1,440 | 676       |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

11

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

117