

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

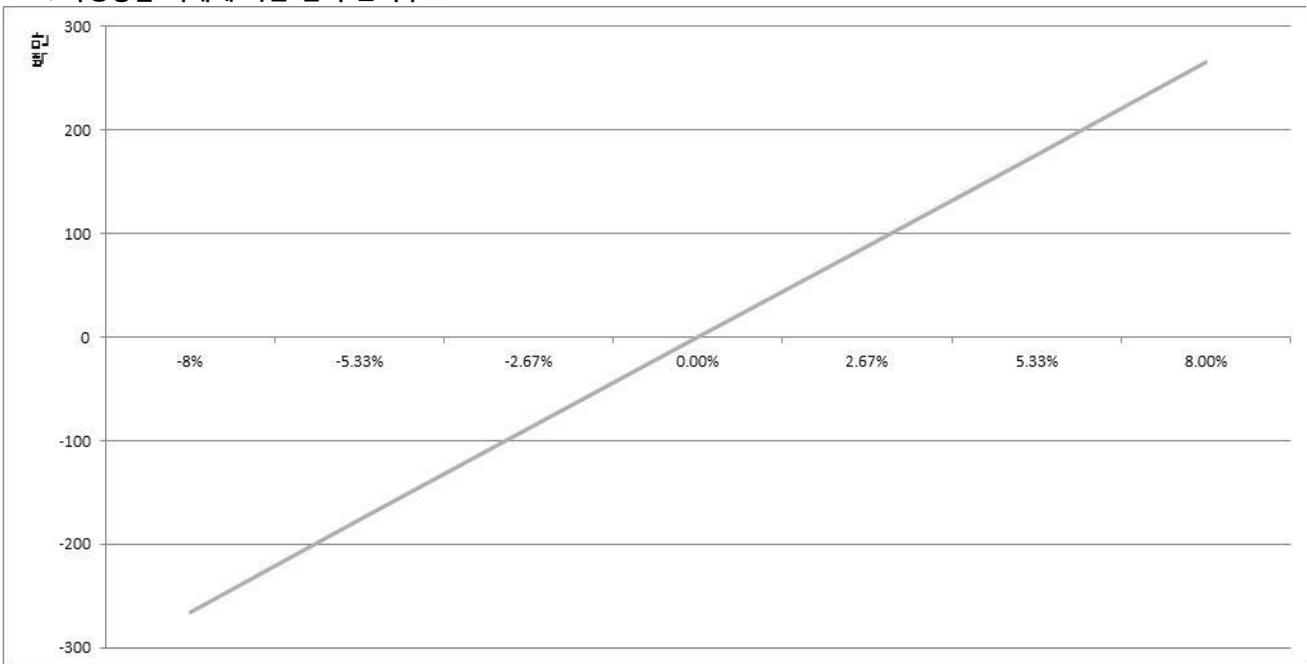
공시일: 2021-06-21

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 | 2,284 | 0 | 2,284 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 109 | 208 | -100 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 13,506 | 0 | 13,506 | 장내 |
| 합계 | | | 15,790 | 0 | 15,790 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

182

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,260

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

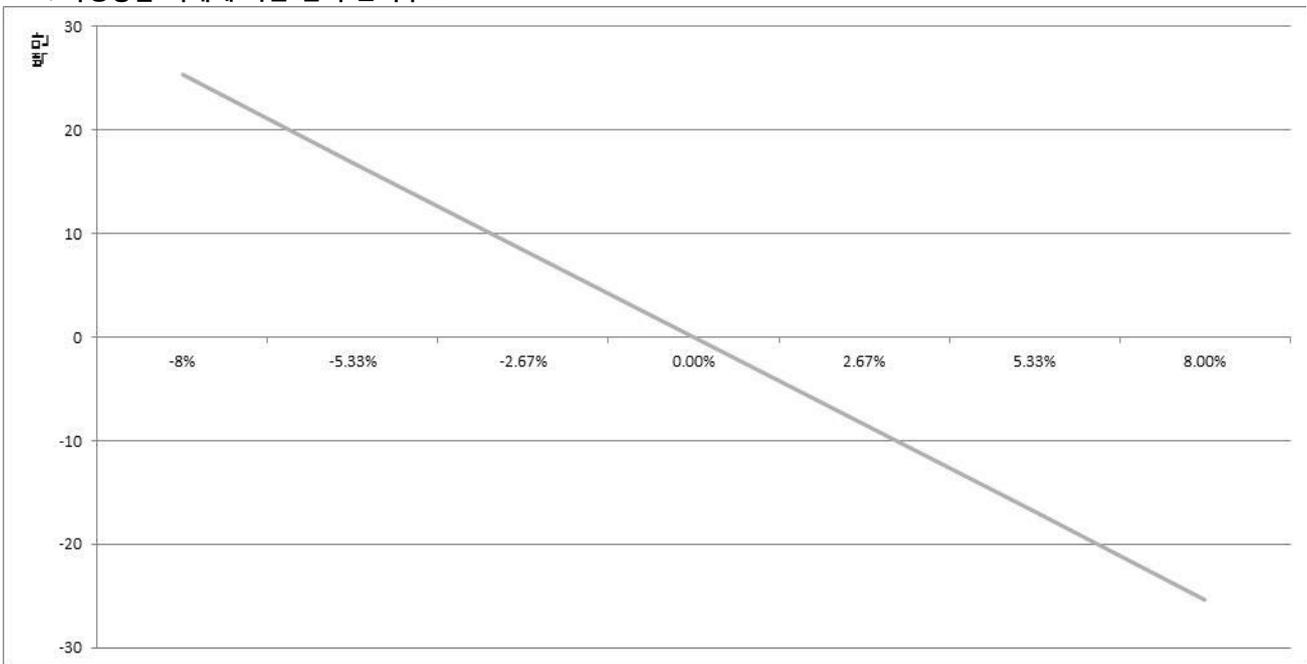
공시일: 2021-06-21

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 | 11,121 | -11,121 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 8 | 0 | 8 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 11,532 | 0 | 11,532 | 장내 |
| 합계 | | | 11,532 | 11,121 | 411 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

882

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

489

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

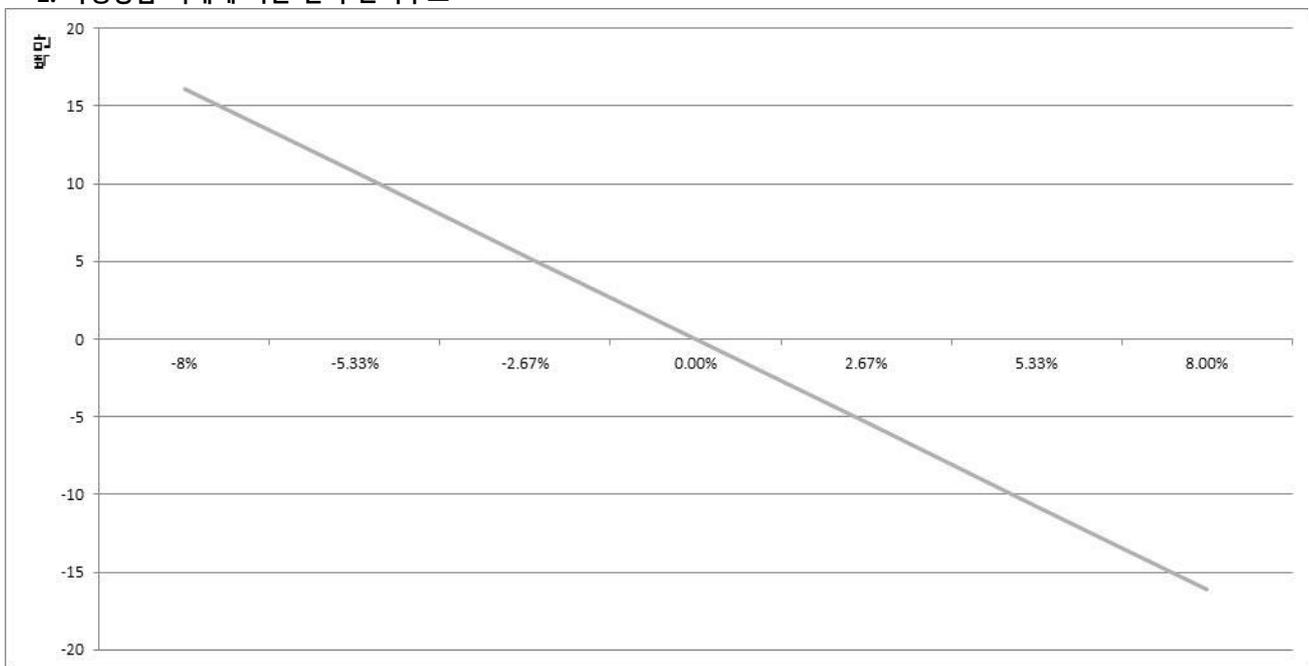
공시일: 2021-06-21

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 110 | 0 | 110 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 5,140 | 804 | 4,337 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 619 | -619 | 장내 |
| 합계 | | | 5,140 | 1,423 | 3,717 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

18

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

322

펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

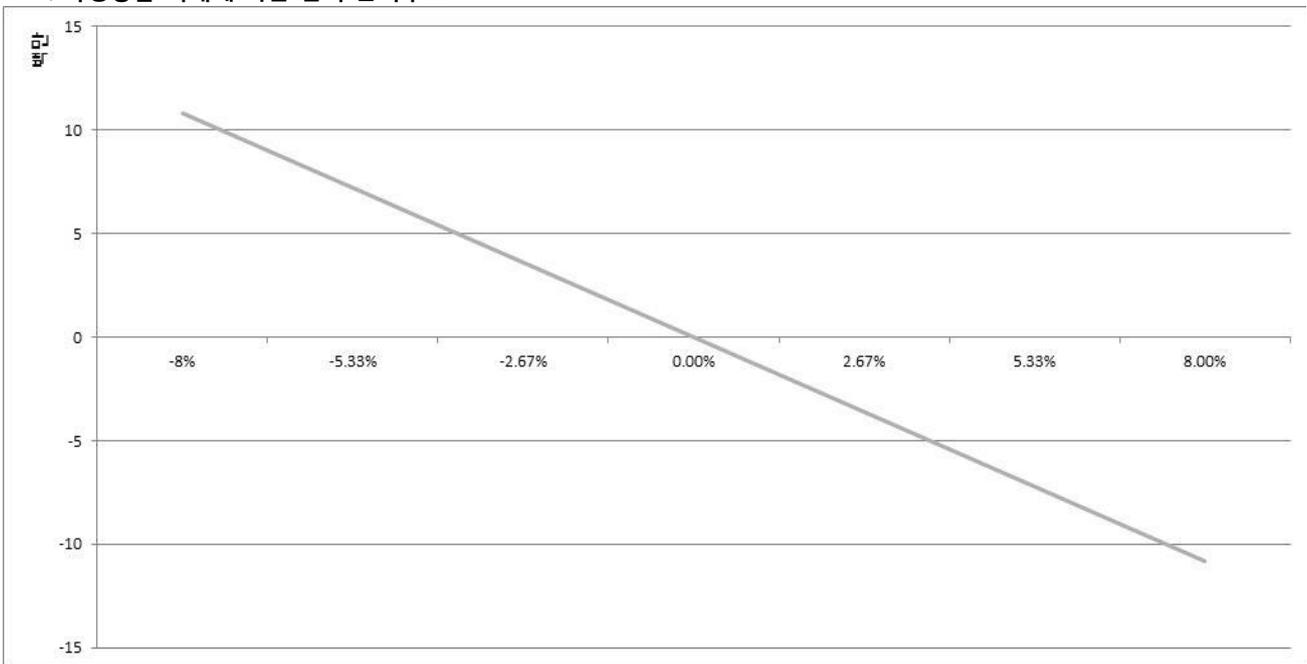
공시일: 2021-06-21

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 | 306 | 0 | 306 | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑 | 0 | 0 | 0 | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑 | 4 | 0 | 4 | 장외 |
| 합계 | | | 310 | 0 | 310 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1