

## 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

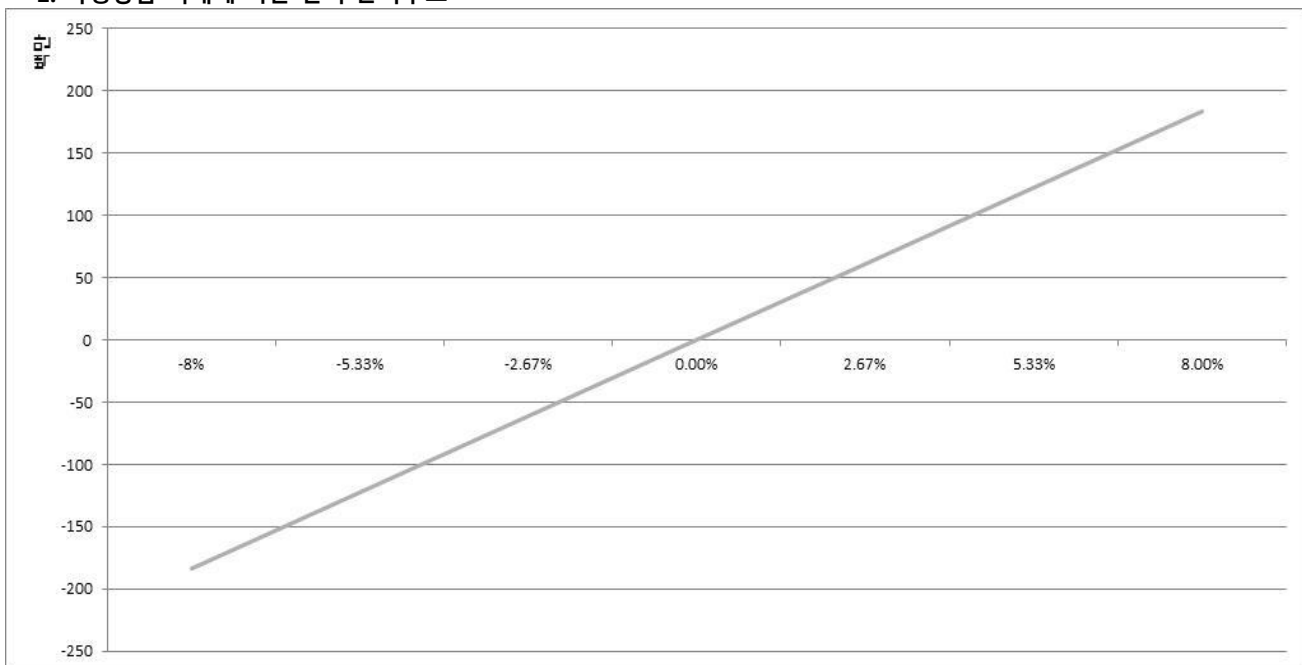
공시일: 2021-06-17

### 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   | 2,294  | 0     | 2,294     | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 23     | 23    | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 13,673 | 0     | 13,673    | 장내 |
| 합계 |      |      | 15,967 | 0     | 15,967    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

183

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,291

## 펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

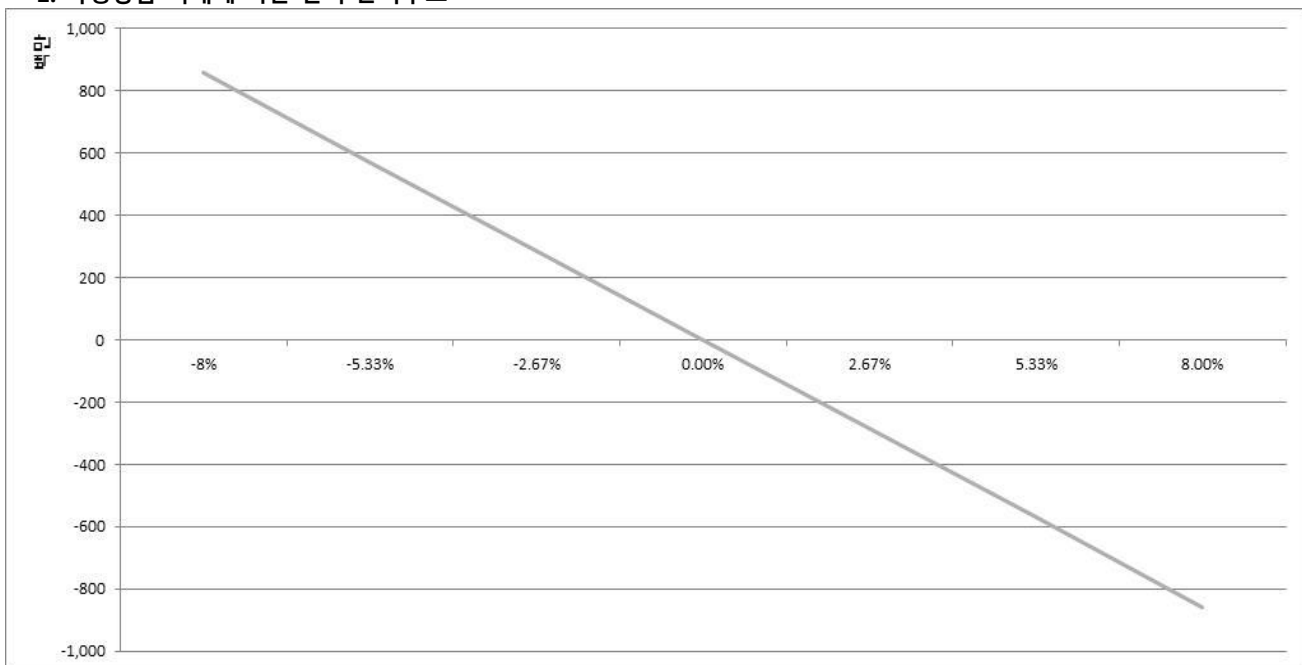
공시일: 2021-06-17

### 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      | 10,813 | -10,813   | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0      | 0      | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 11,079 | 0      | 11,079    | 장내 |
| 합계 |      |      | 11,079 | 10,813 | 266       |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

857

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

474

## 펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

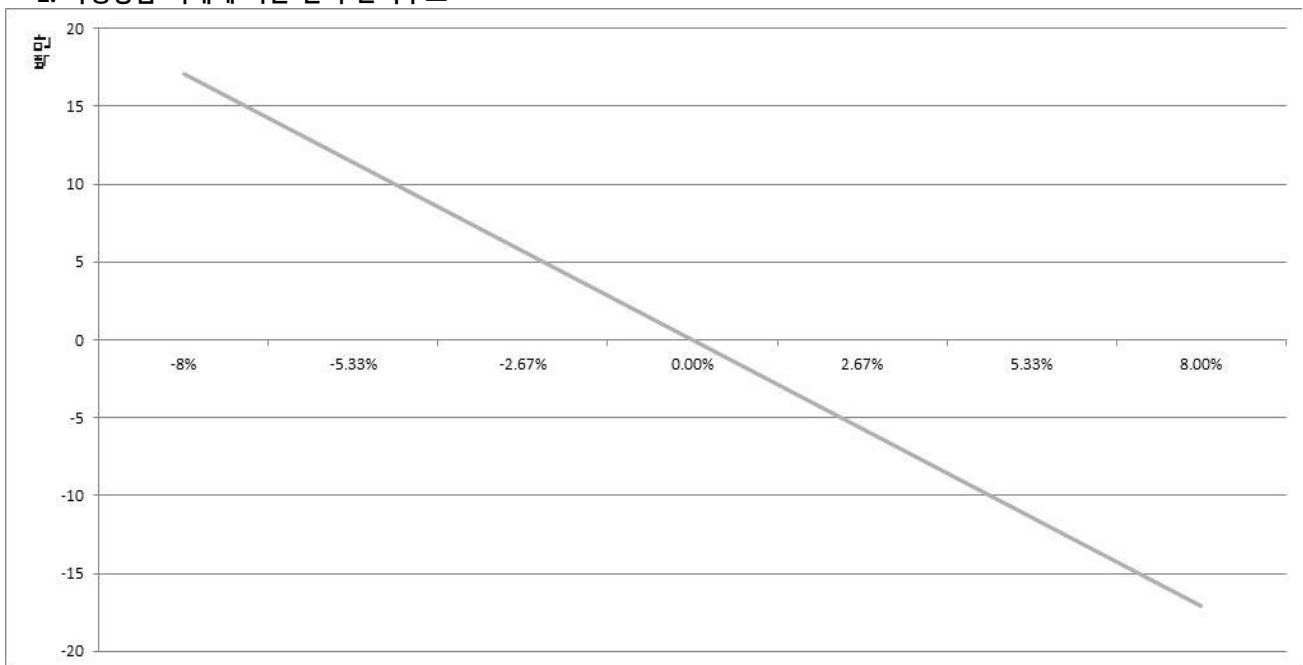
공시일: 2021-06-17

### 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   | 5,018 | 805   | 4,212     | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 0     | 600   | -600      | 장내 |
| 합계 |      |      | 5,018 | 1,405 | 3,613     |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

309

## 펀드명 : 트러스톤다이나믹아시아(모)

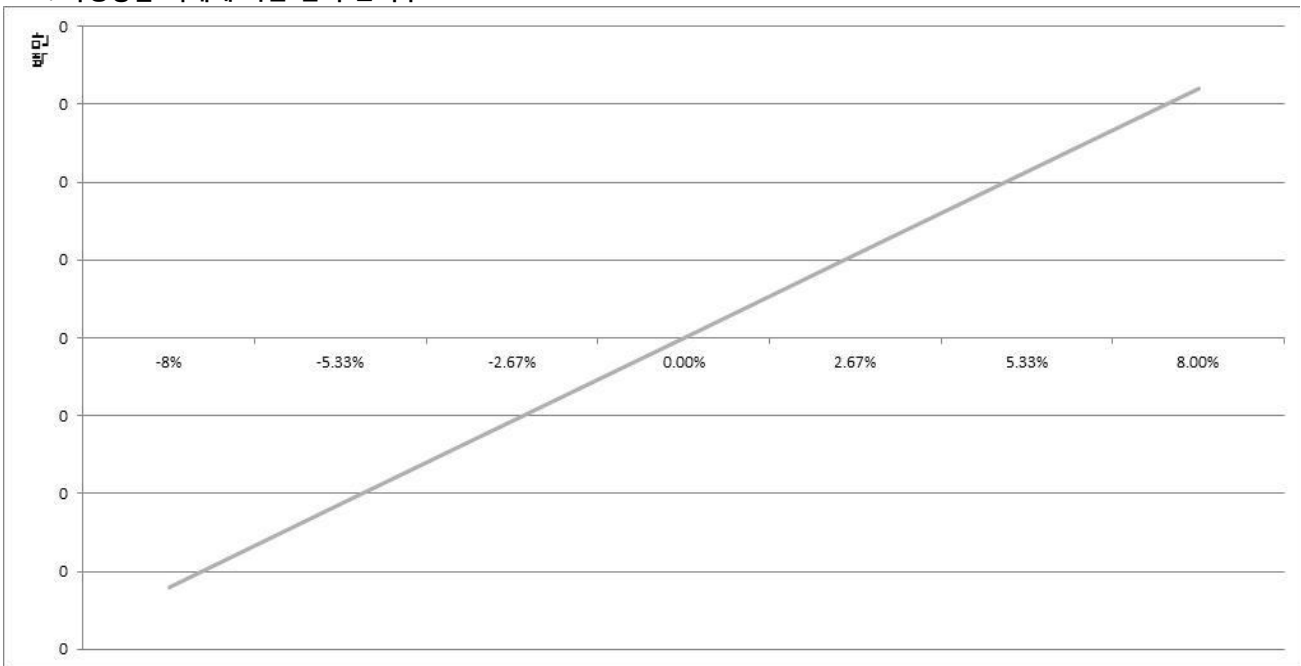
공시일: 2021-06-17

### 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   | 294   | 0     | 294       | 장내 |
| 신규 | 주가지수 | 스왑   | 0     | 150   | -150      | 장외 |
| 누계 | 주가지수 | 스왑   | 4     | 0     | 4         | 장외 |
| 합계 |      |      | 298   | 0     | 298       |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2