

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

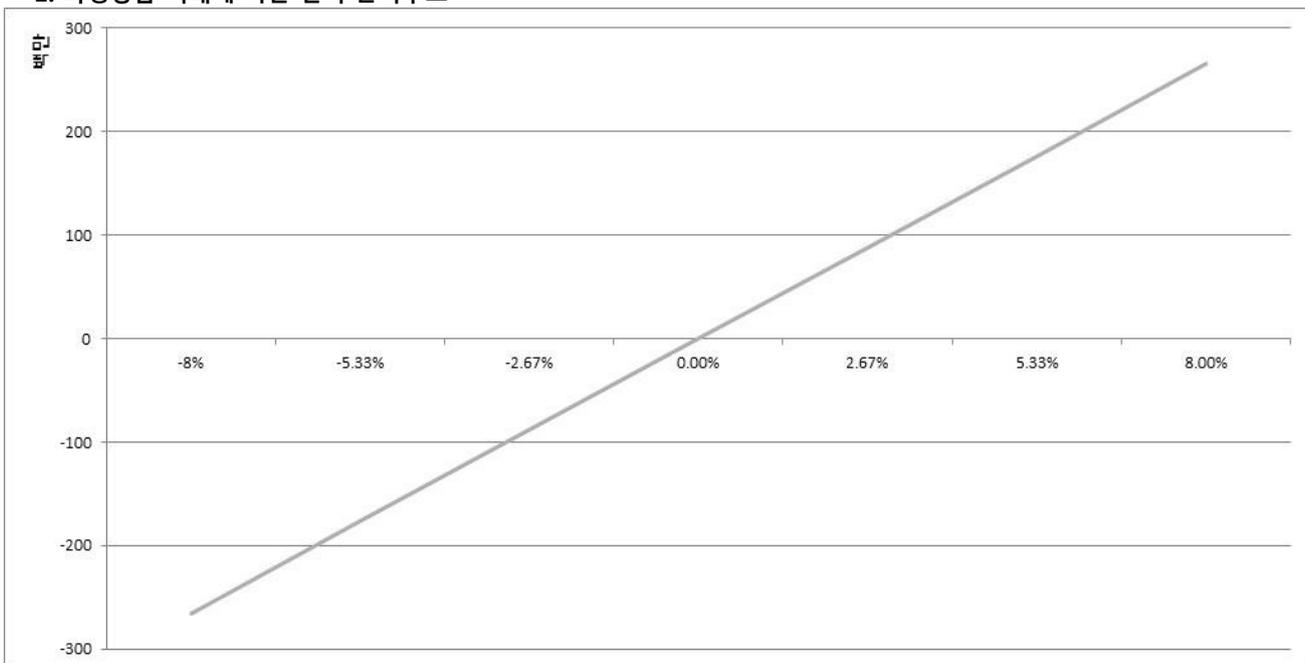
공시일: 2021-09-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 210 | 0 | 210 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 18,267 | 0 | 18,267 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 6 | 0 | 6 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 33,001 | 0 | 33,001 | 장내 |
| 합계 | | | 51,267 | 0 | 51,267 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,461

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,510

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

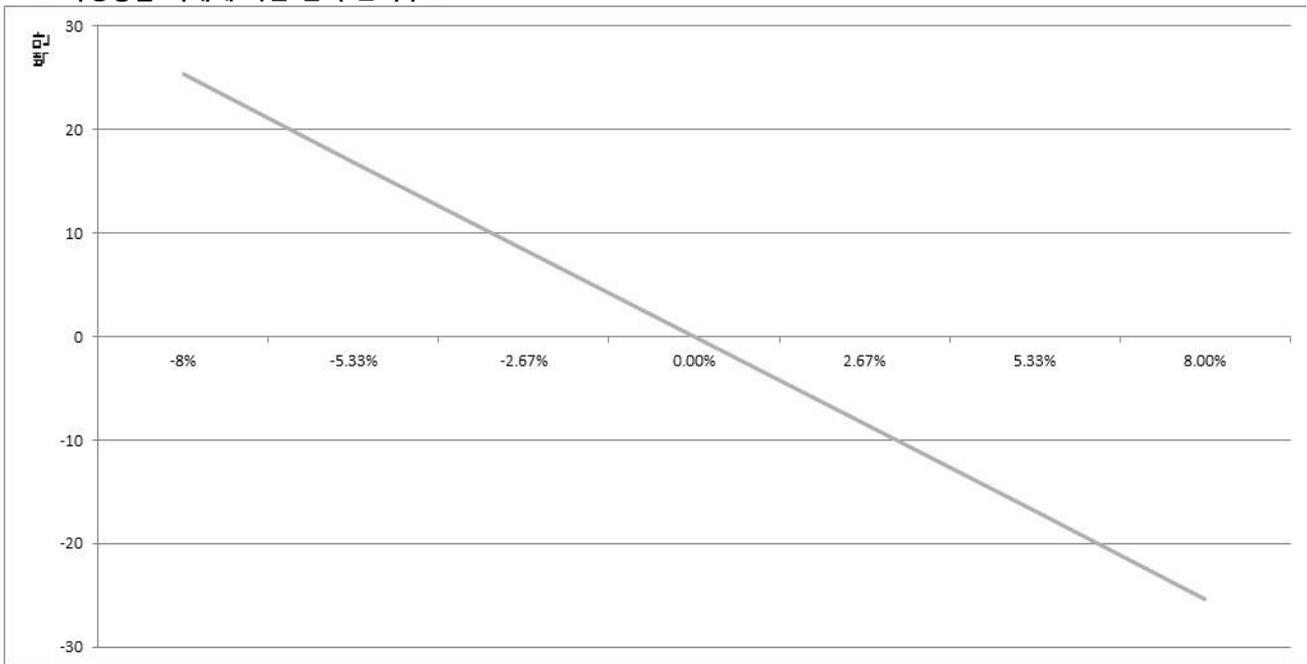
공시일: 2021-09-02

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 | 15,637 | -15,637 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 18,538 | 0 | 18,538 | 장내 |
| 합계 | | | 18,538 | 15,637 | 2,902 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,242

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

753

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

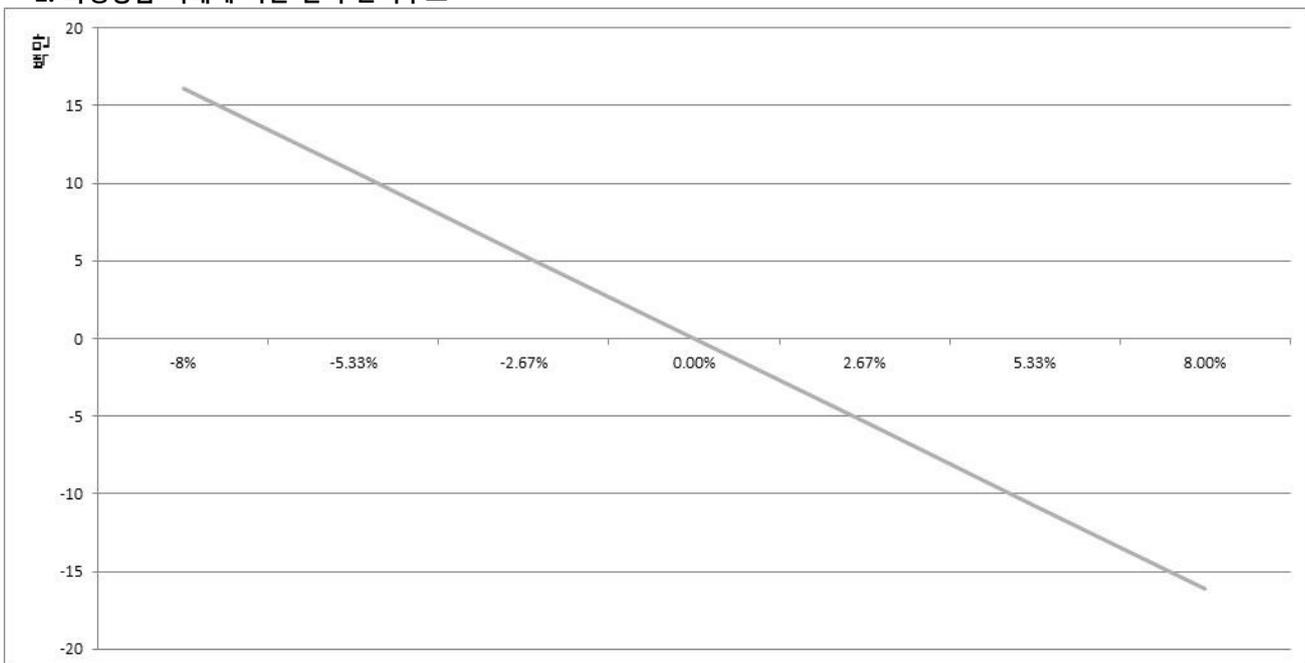
공시일: 2021-09-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주식 | 주식 | 198 | 0 | 198 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 4,700 | 1,110 | 3,590 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 409 | -409 | 장내 |
| 합계 | | | 4,700 | 1,519 | 3,181 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

293