

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

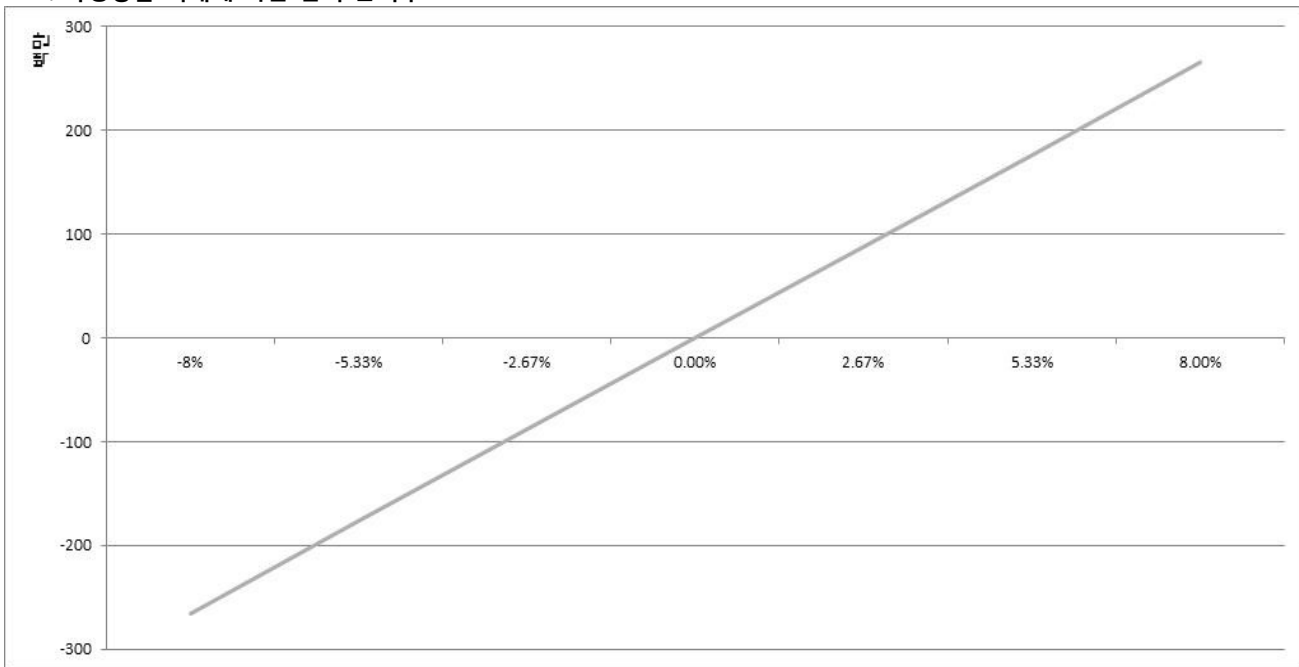
공시일: 2021-09-14

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	4,097	0	4,097	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	44,477	0	44,477	장내
합계			48,574	0	48,574	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

328

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,804

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

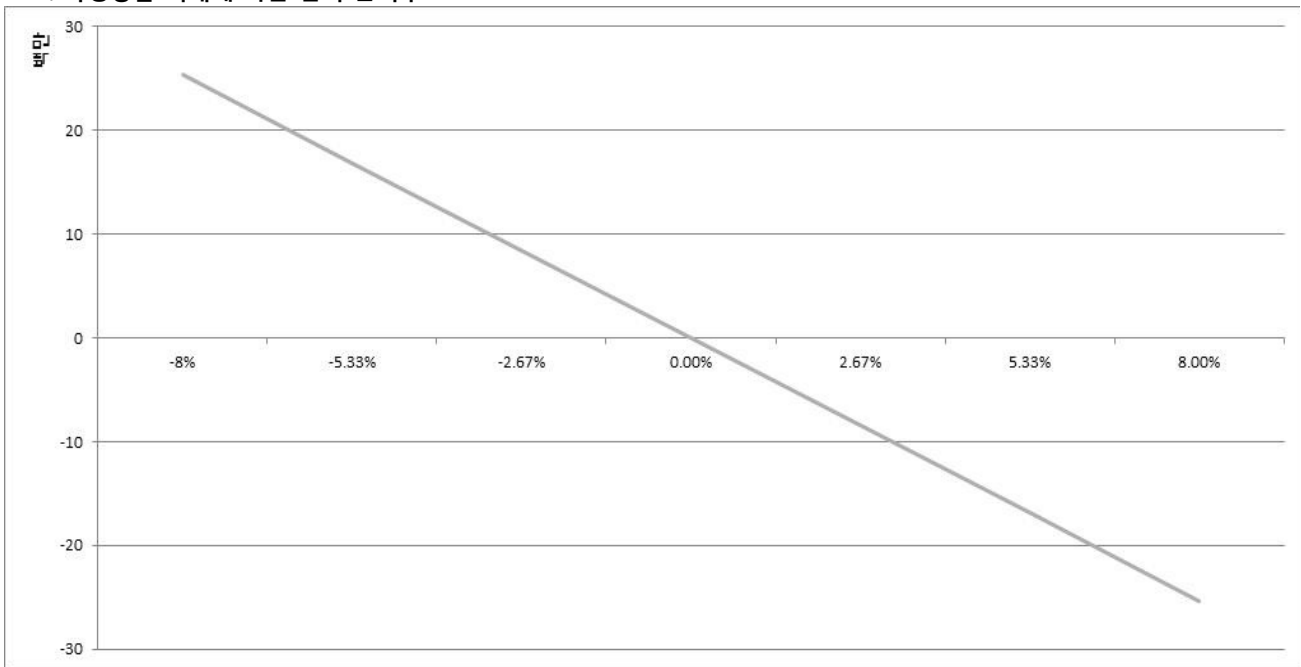
공시일: 2021-09-14

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	15,340	-15,340	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	18,278	0	18,278	장내
합계			18,278	15,340	2,939	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,209

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

855

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

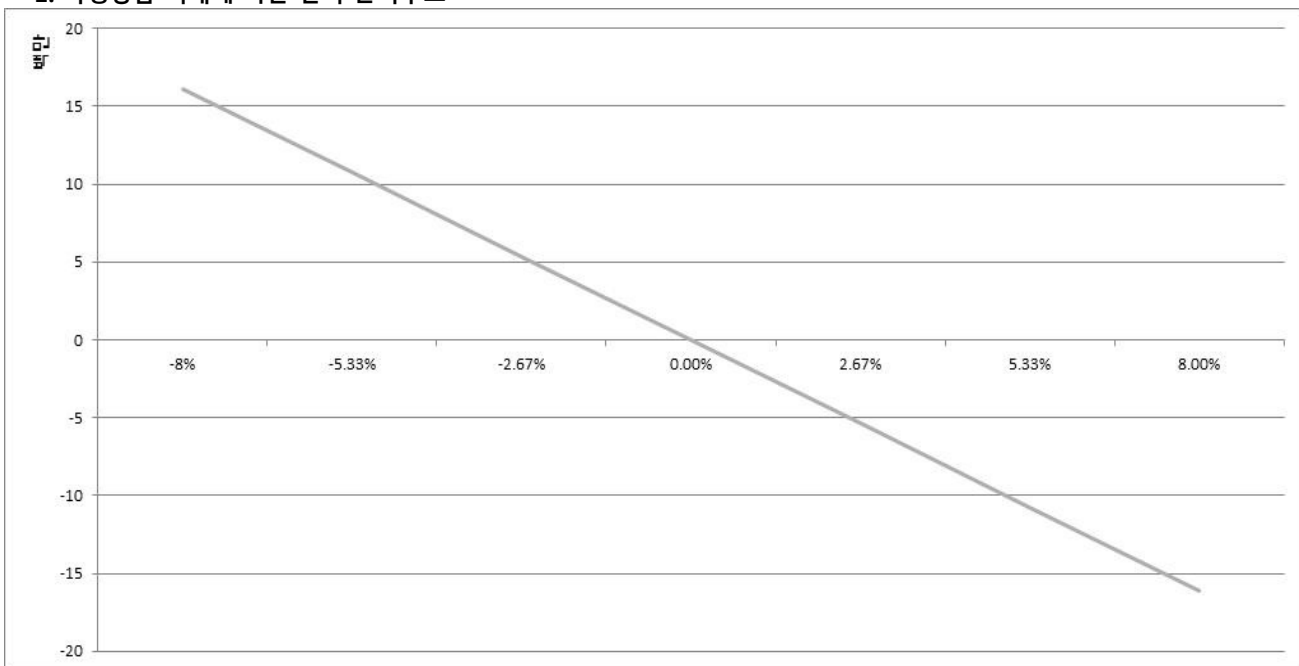
공시일: 2021-09-14

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	96	300	-204	장내
누계	주식	주식	5,024	1,087	3,937	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	0	401	-401	장내
합계			5,024	1,487	3,536	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

17

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

292