

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

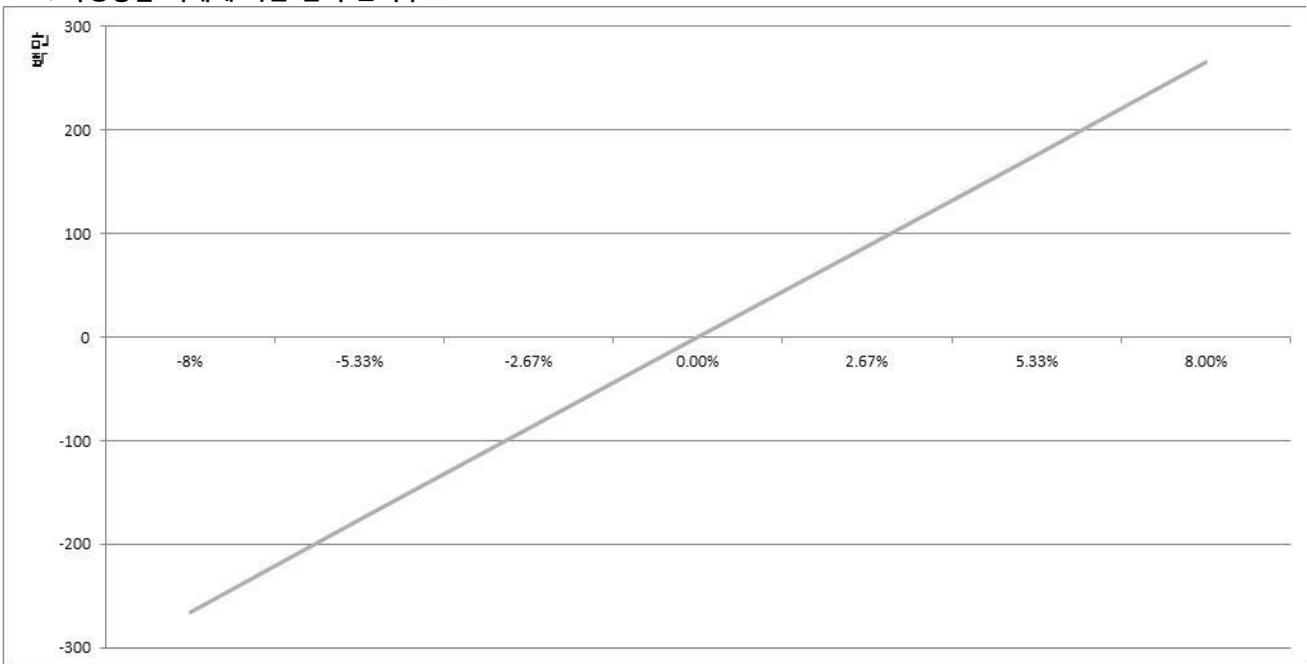
공시일: 2021-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 2,394 | 3,492 | -1,097 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 499 | 0 | 499 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 15 | 2,375 | -2,360 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 37,473 | 0 | 37,473 | 장내 |
| 합계 | | | 37,972 | 0 | 37,972 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

40

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

3,255

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

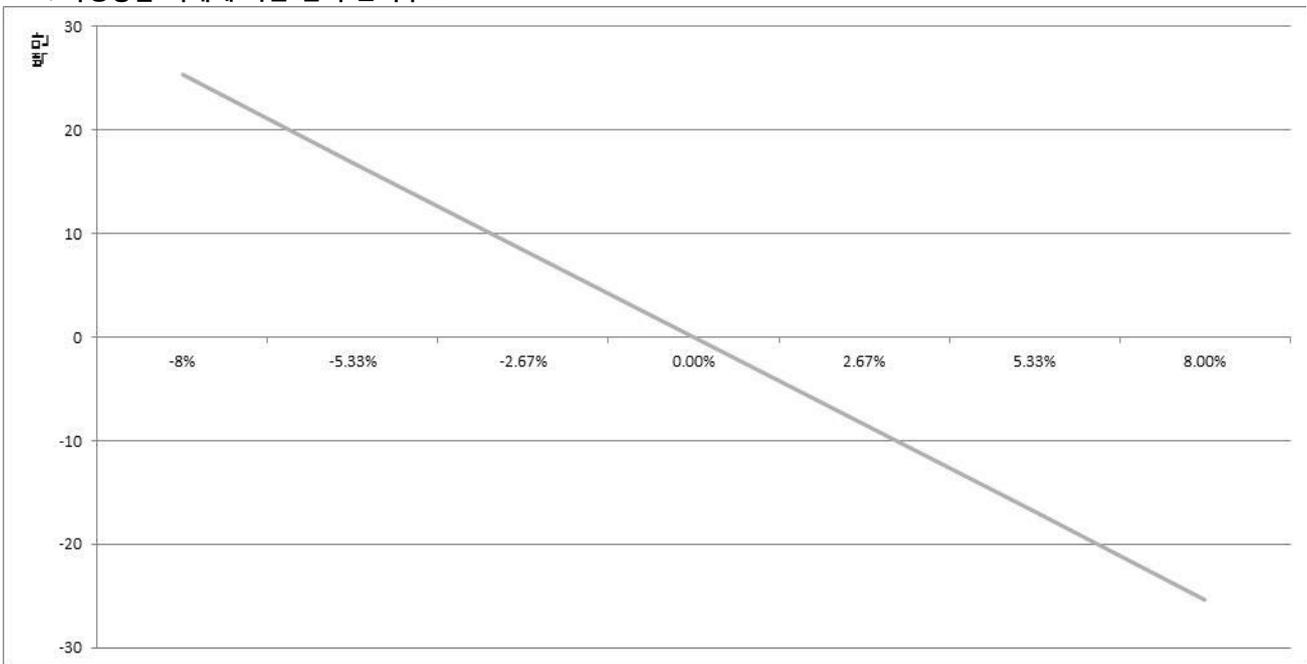
공시일: 2021-10-27

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 | 15,217 | -15,217 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 18,197 | 0 | 18,197 | 장내 |
| 합계 | | | 18,197 | 15,217 | 2,979 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

1,206

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

1,120

펀드명 : 트러스톤정정당당[주식-파생형](모)

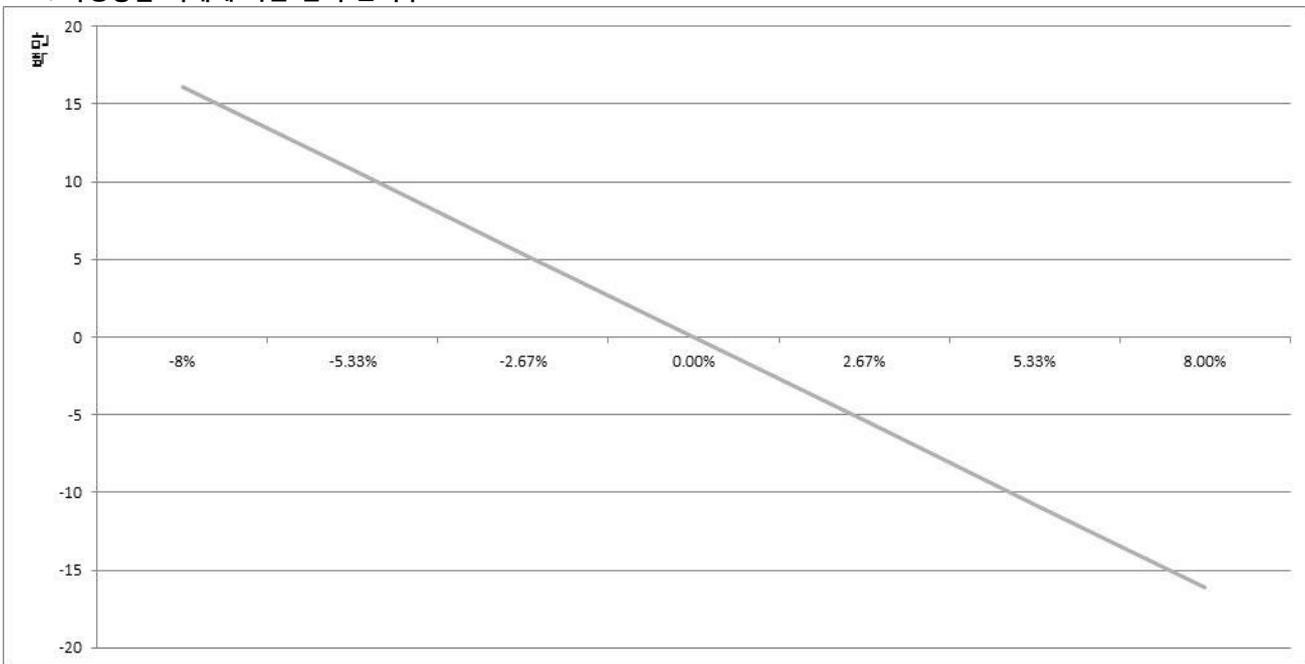
공시일: 2021-10-27

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 | 5,354 | 1,261 | 4,094 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 0 | 592 | -592 | 장내 |
| 합계 | | | 5,354 | 1,852 | 3,502 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

21

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

278