

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

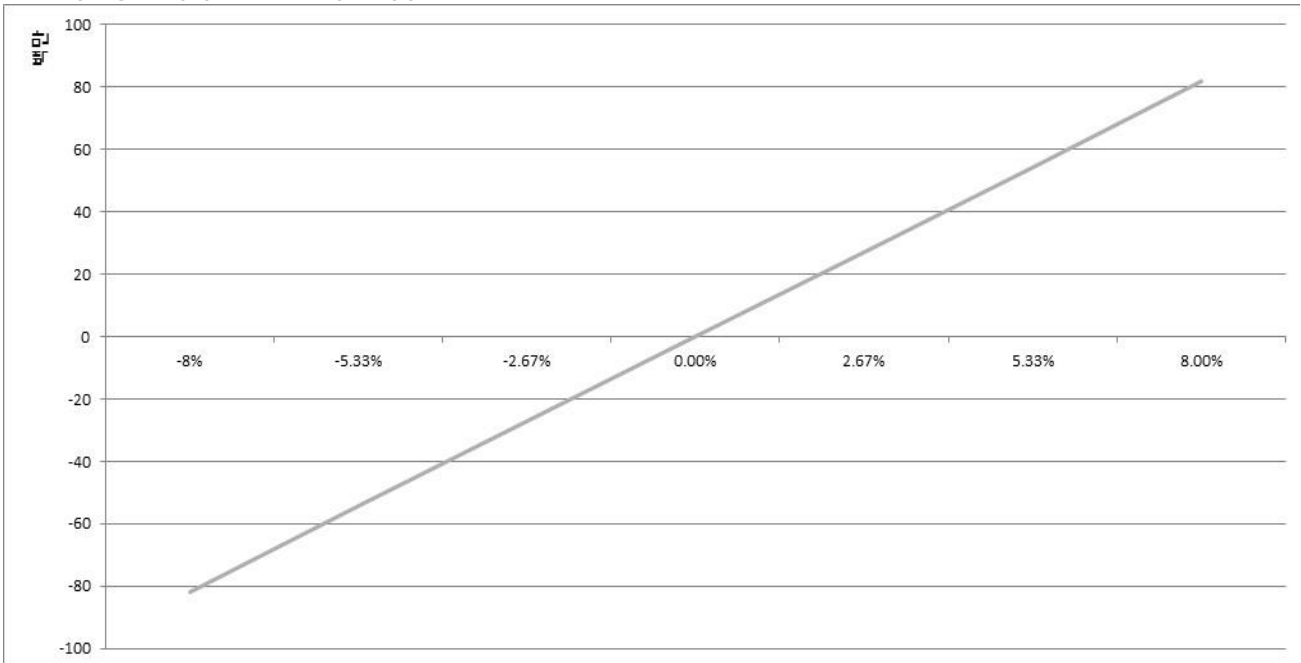
공시일: 2023-09-06

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 | 1,021 | 0 | 1,021 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 32,215 | 0 | 32,215 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 308 | 0 | 308 | 장내 |
| 합계 | | | 33,544 | 0 | 33,544 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

82

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,461

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

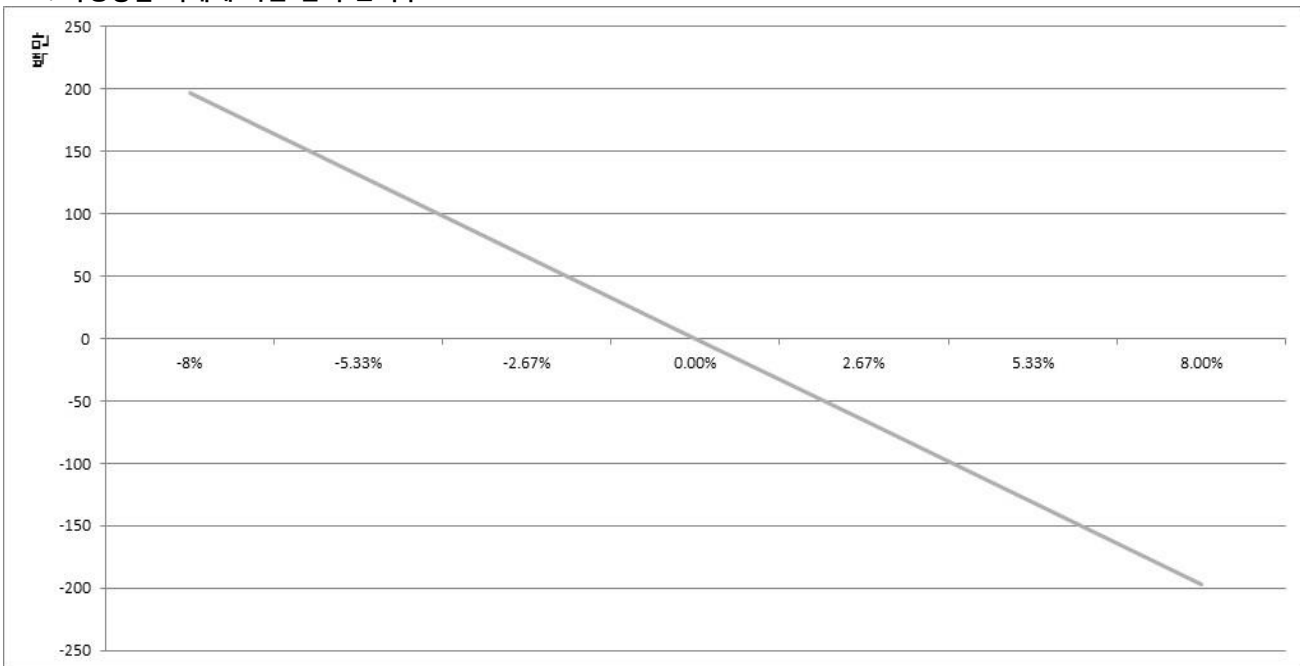
공시일: 2023-09-06

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 | 2,464 | -2,464 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 1 | 0 | 1 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 5,087 | 0 | 5,087 | 장내 |
| 합계 | | | 5,087 | 2,464 | 2,624 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

197

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

304