

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

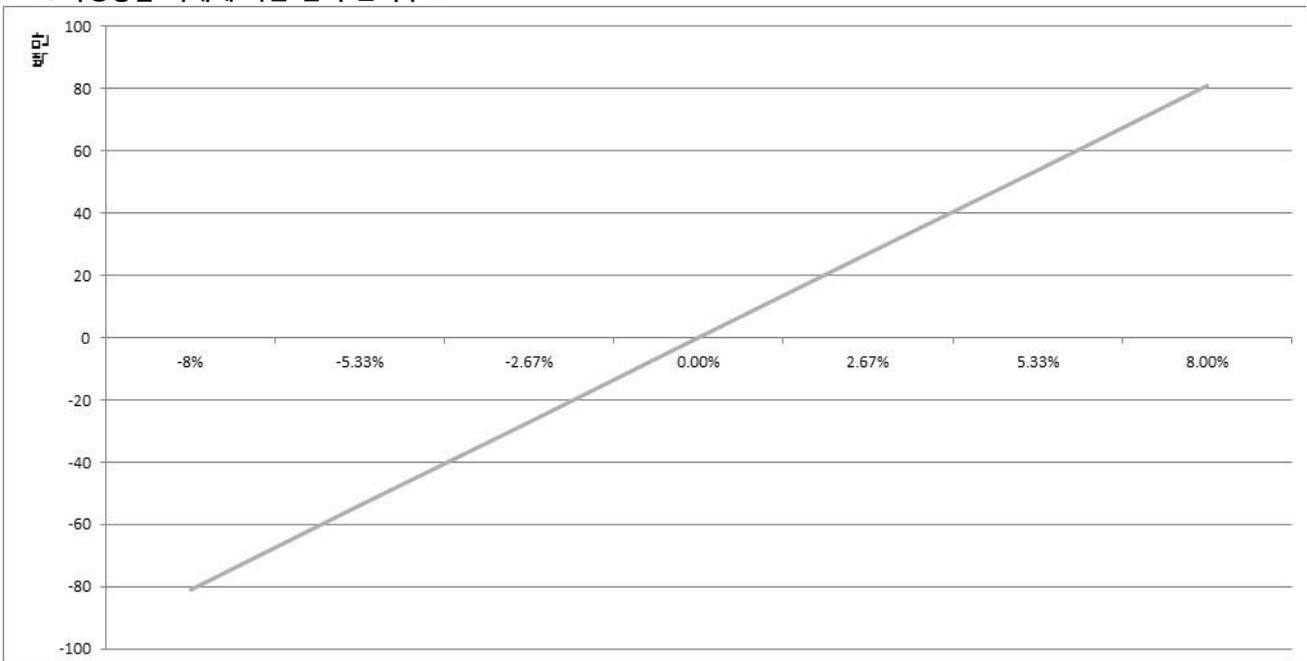
공시일: 2023-09-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 256 | 256 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 1,024 | 0 | 1,024 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 787 | 0 | 787 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 33,445 | 0 | 33,445 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 787 | -787 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 47 | 880 | -833 | 장내 |
| 합계 | | | 34,515 | 880 | 33,635 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,428

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

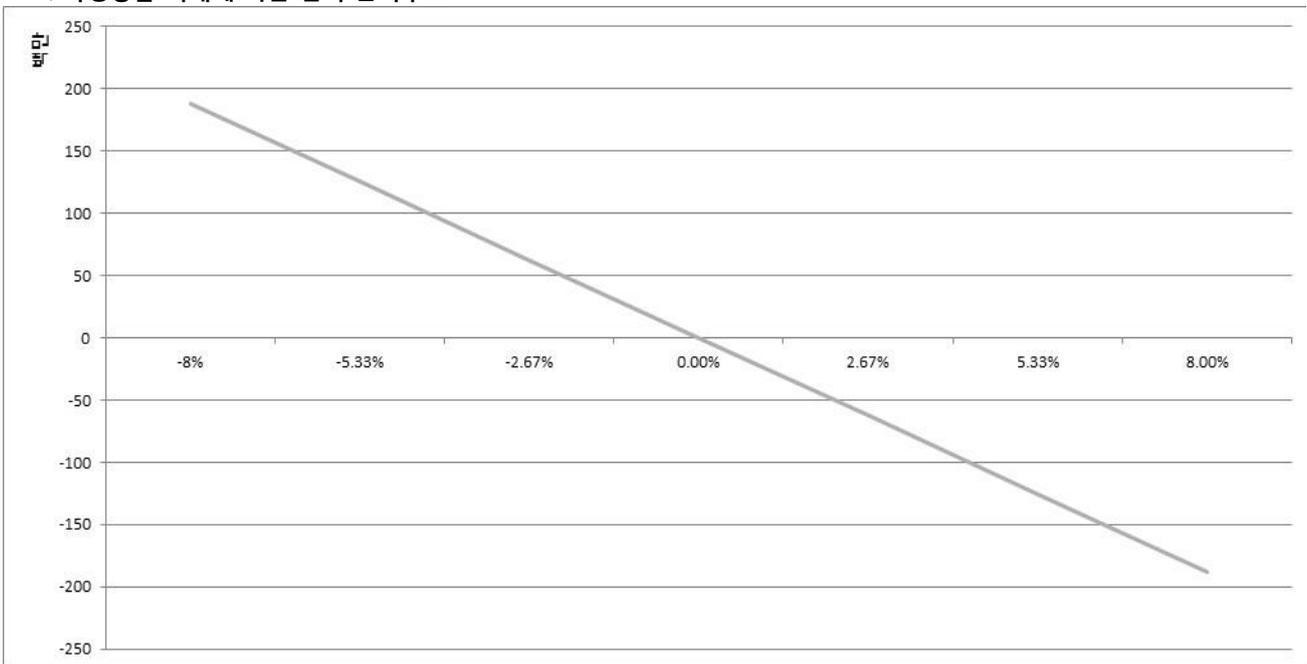
공시일: 2023-09-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 2,392 | 2,392 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 2,392 | -2,392 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 4,994 | 0 | 4,994 | 장내 |
| 합계 | | | 4,994 | 2,392 | 2,602 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

0

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

306