

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

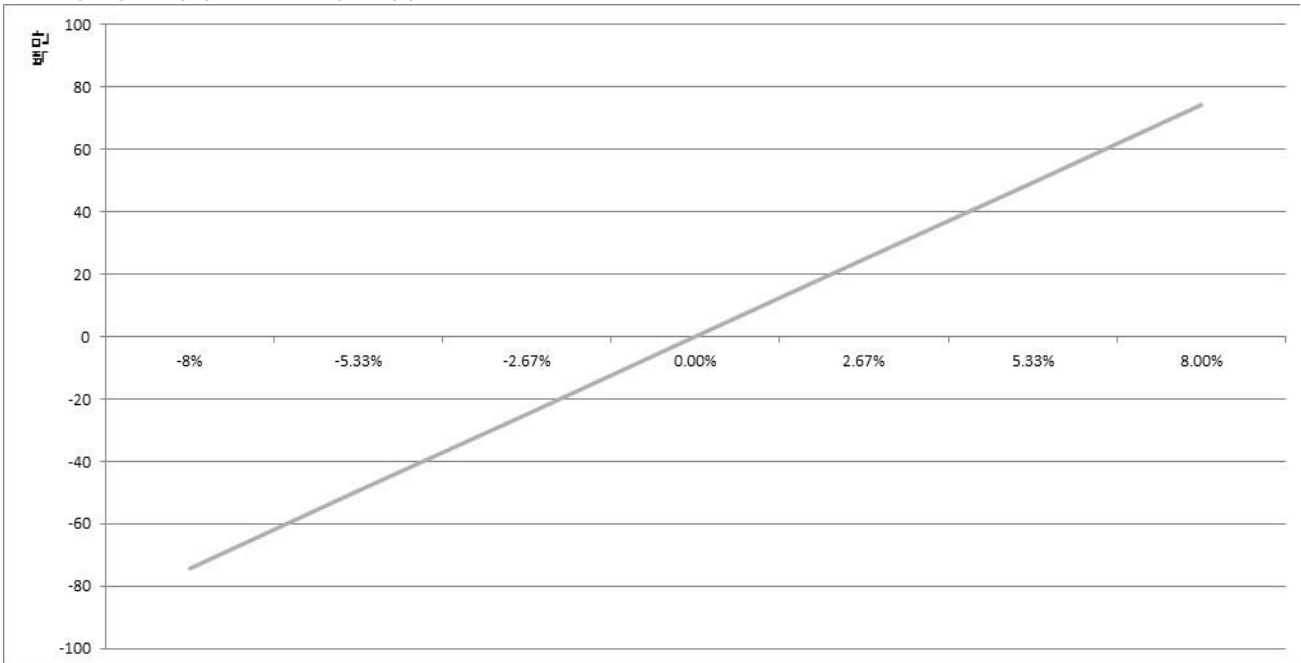
공시일: 2023-10-27

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 | 923 | 0 | 923 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 28,989 | 0 | 28,989 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 449 | 0 | 449 | 장내 |
| 합계 | | | 30,361 | 0 | 30,361 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

74

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,139

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

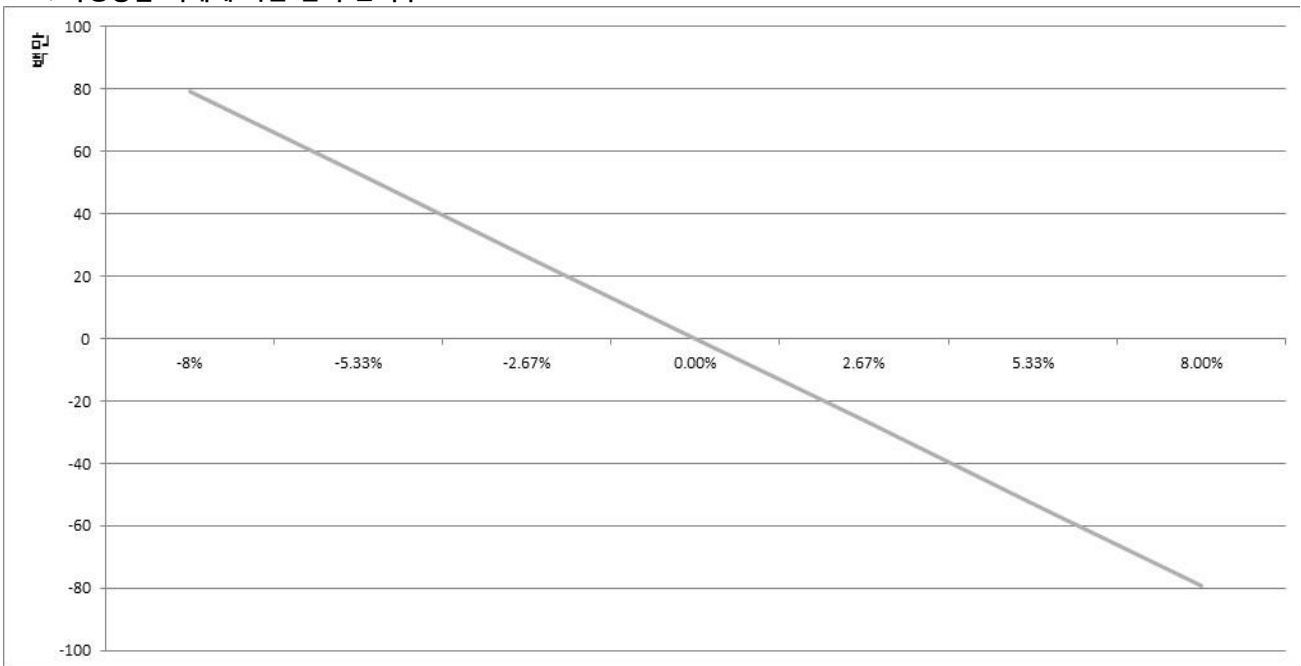
공시일: 2023-10-27

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1) | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|-------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물 | 174 | 0 | 174 | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물 | 0 | 984 | -984 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 8 | 8 | 0 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 4,339 | 0 | 4,339 | 장내 |
| 합계 | | | 4,339 | 984 | 3,355 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

79

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

410