

# 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

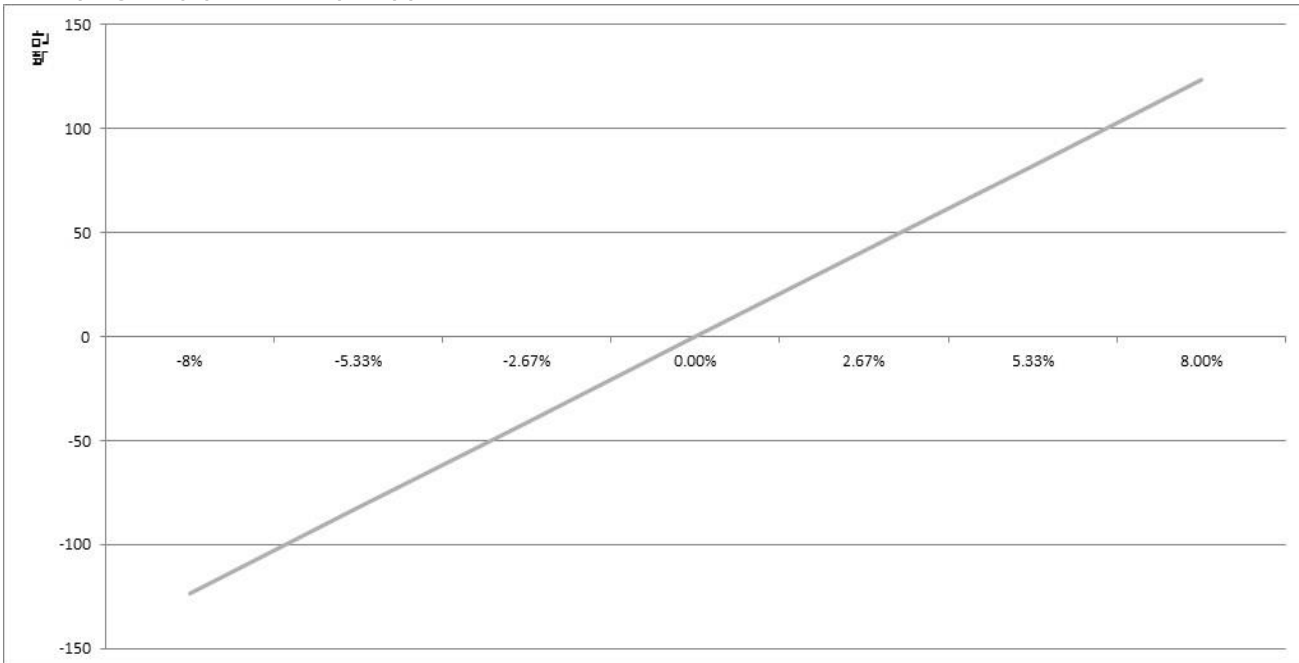
공시일: 2024-02-02

## 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   | 1,541  | 0     | 1,541     | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 4      | 435   | -431      | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 35,561 | 0     | 35,561    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 435    | 0     | 435       | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 1,025  | 0     | 1,025     | 장내 |
| 합계 |      |      | 38,127 | 0     | 38,127    |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

123

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,534

# 펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

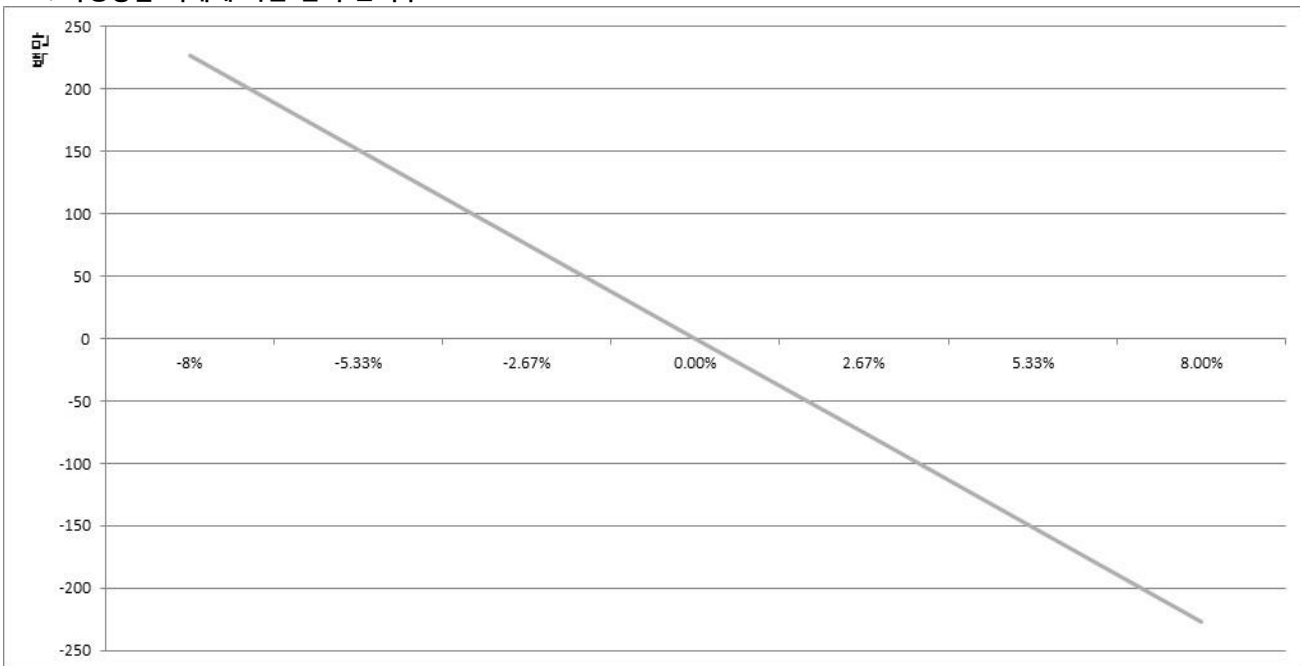
공시일: 2024-02-02

## 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     | 2,820 | -2,820    | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 4,317 | 0     | 4,317     | 장내 |
| 합계 |      |      | 4,317 | 2,820 | 1,497     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

227

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

243