

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

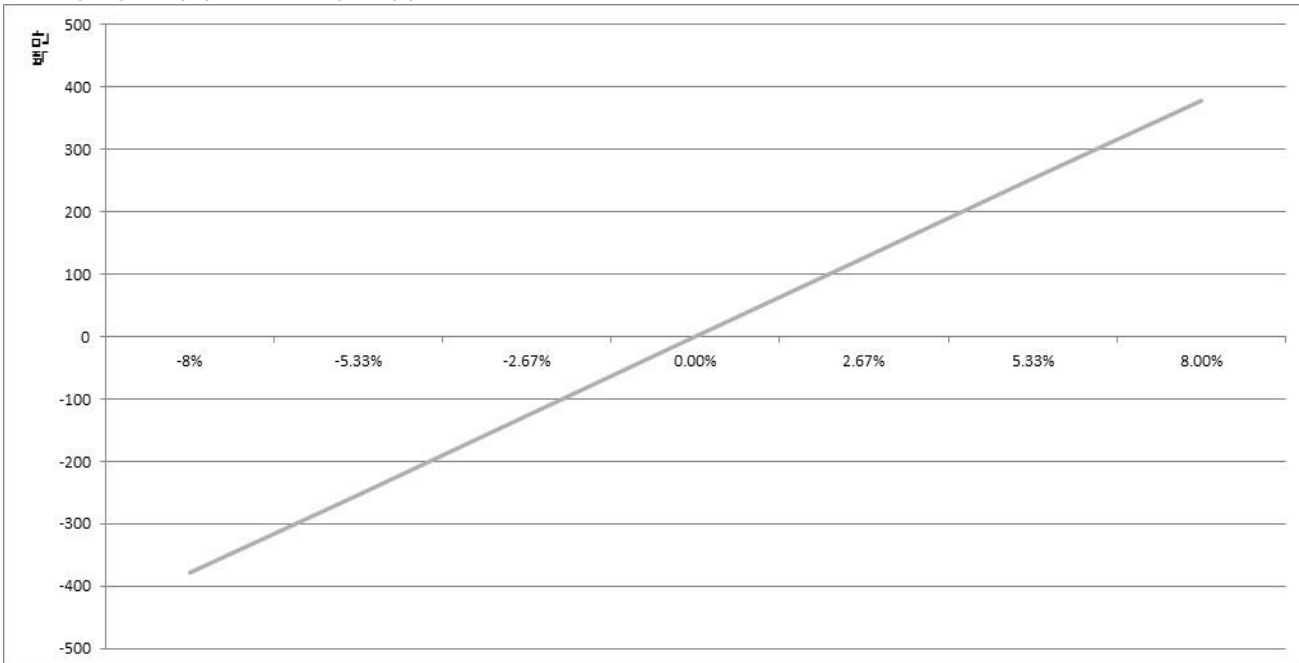
공시일: 2024-04-25

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 | 4,727 | 0 | 4,727 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 186 | -186 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 37,625 | 0 | 37,625 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 186 | 0 | 186 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 1,384 | 0 | 1,384 | 장내 |
| 합계 | | | 43,735 | 0 | 43,735 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

379

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,920

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

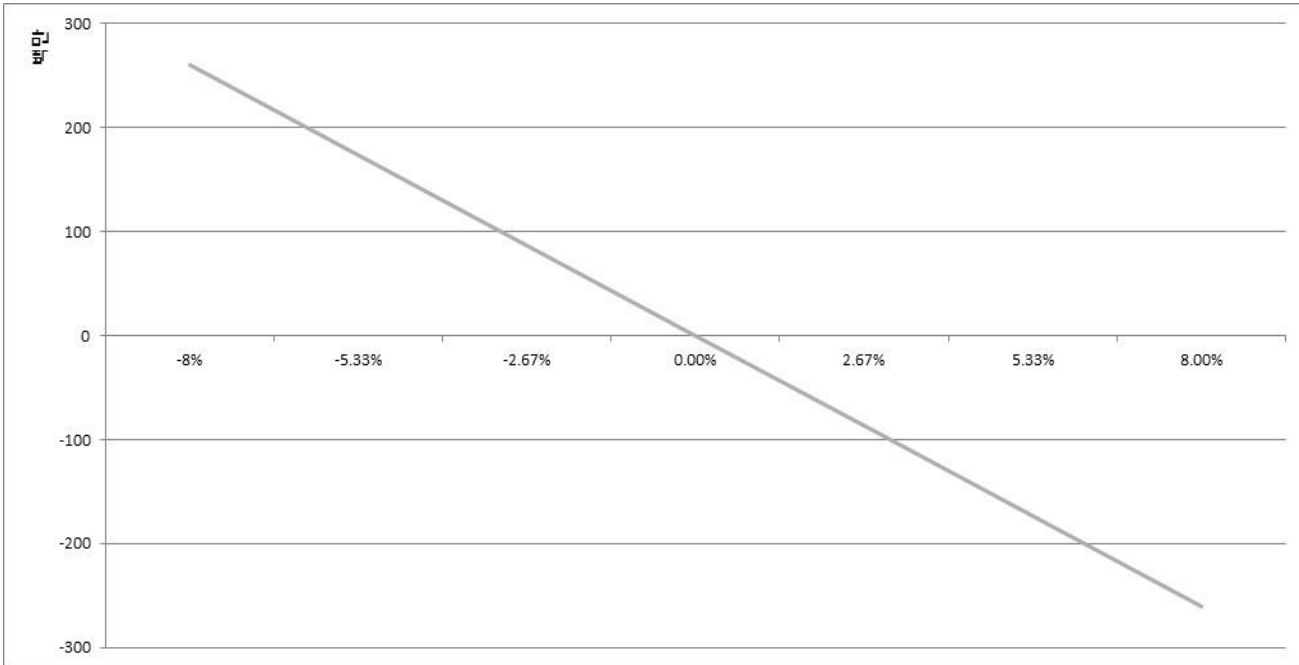
공시일: 2024-04-25

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 | 3,233 | -3,233 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 51 | 74 | -23 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 6,289 | 0 | 6,289 | 장내 |
| 합계 | | | 6,289 | 3,233 | 3,056 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

260

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

695