

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

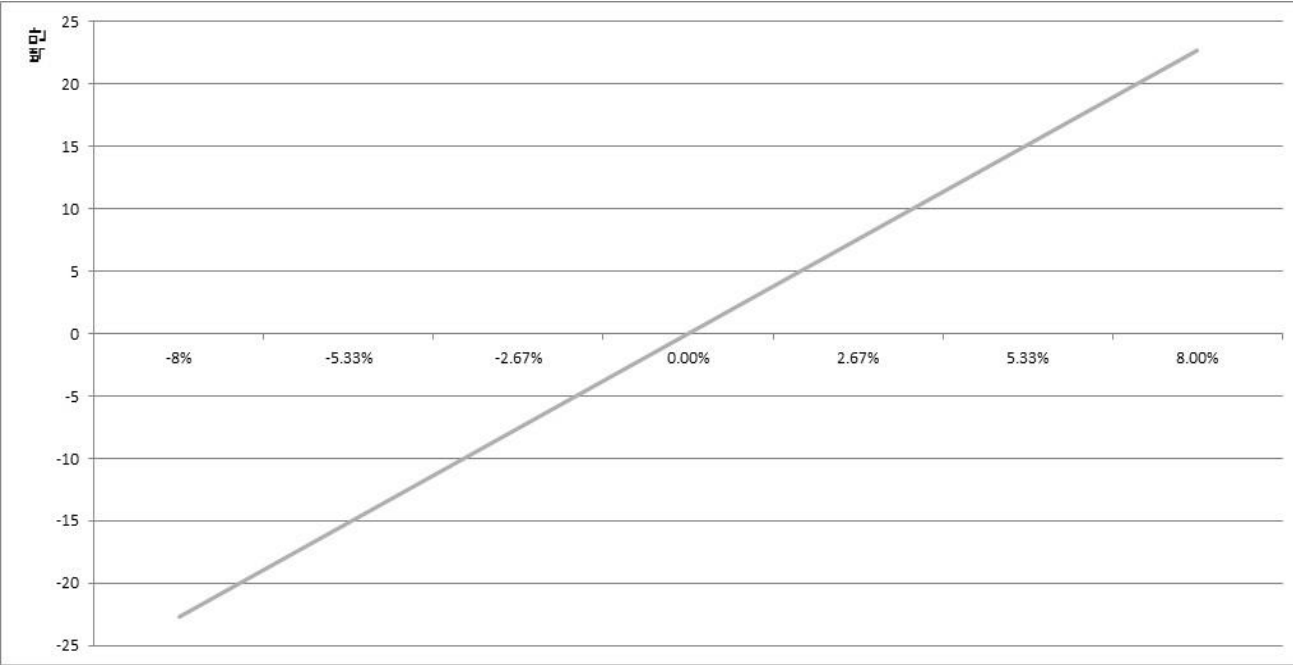
공시일: 2024-07-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 197    | 197   | 0         | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 29,168 | 0     | 29,168    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 573    | 0     | 573       | 장내 |
| 합계 |      |      | 29,741 | 0     | 29,741    |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,227

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

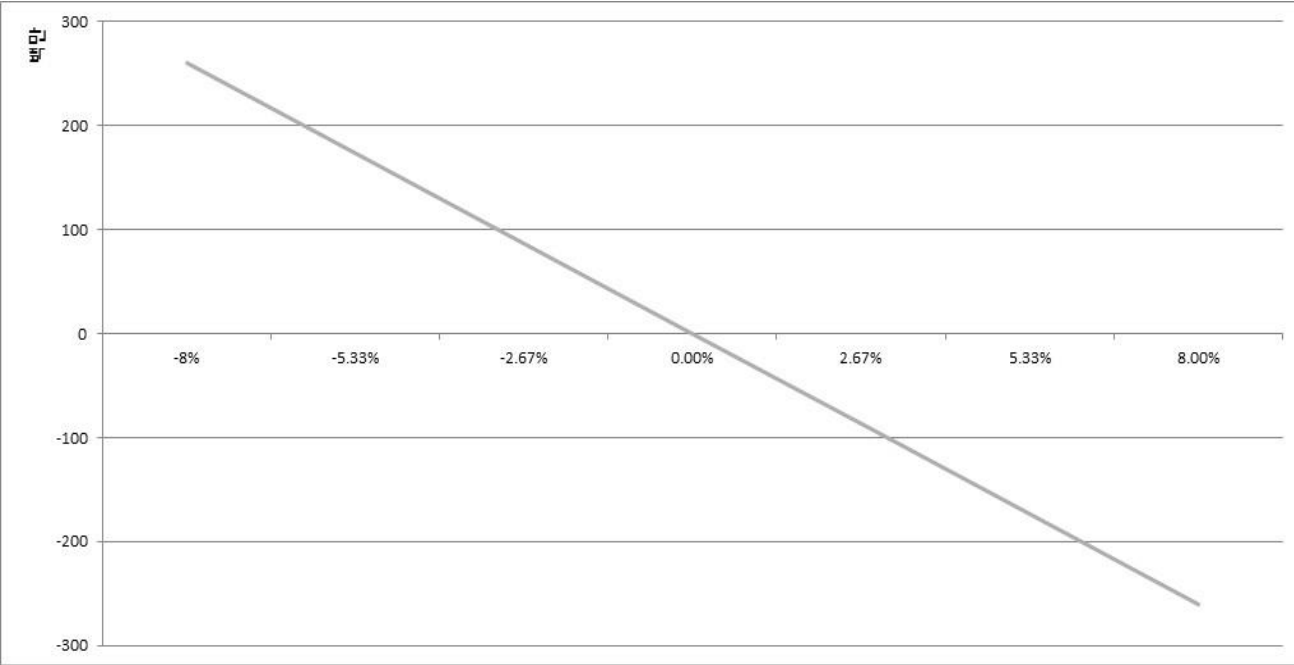
공시일: 2024-07-09

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     | 3,268 | -3,268    | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 4,367 | 0     | 4,367     | 장내 |
| 합계 |      |      | 4,367 | 3,268 | 1,099     |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

260

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

360