

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

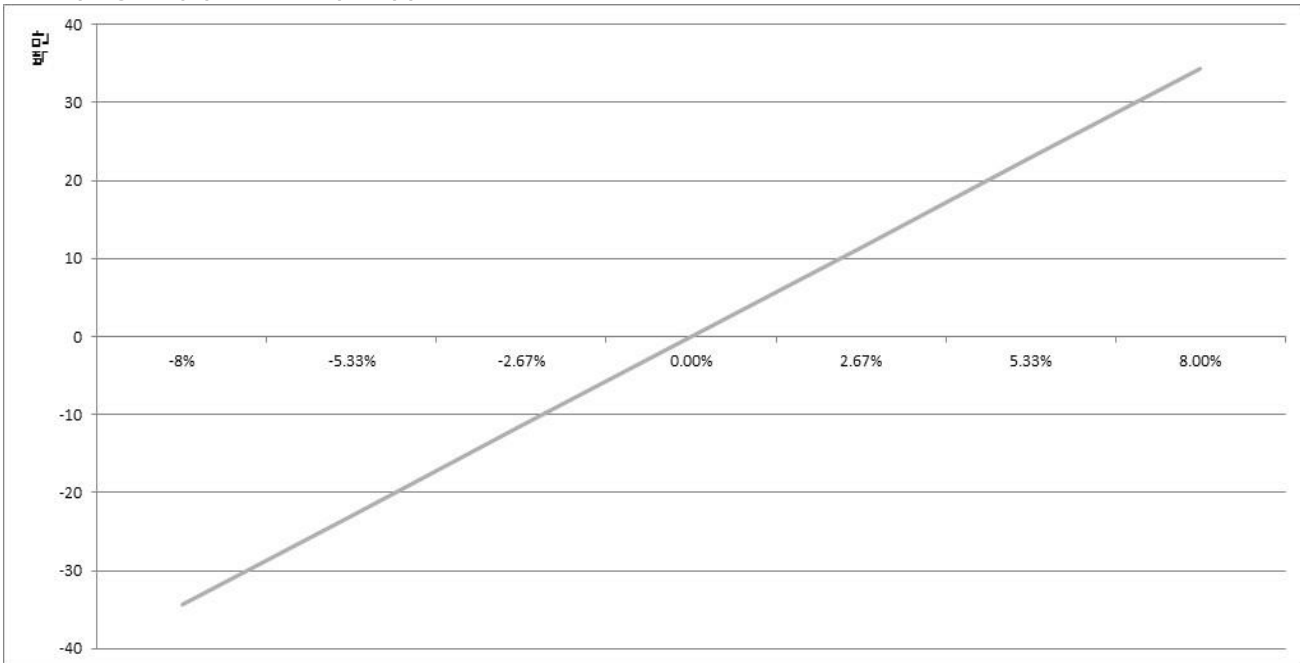
공시일: 2023-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	257	-257	장내
누계	주가지수	선물	428	0	428	장내
신규	주식	주식	247	59	189	장내
누계	주식	주식	32,747	0	32,747	장내
신규	유가증권	선물	0	38	-38	장내
누계	유가증권	선물	0	87	-87	장내
합계			33,175	87	33,088	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

34

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,692

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

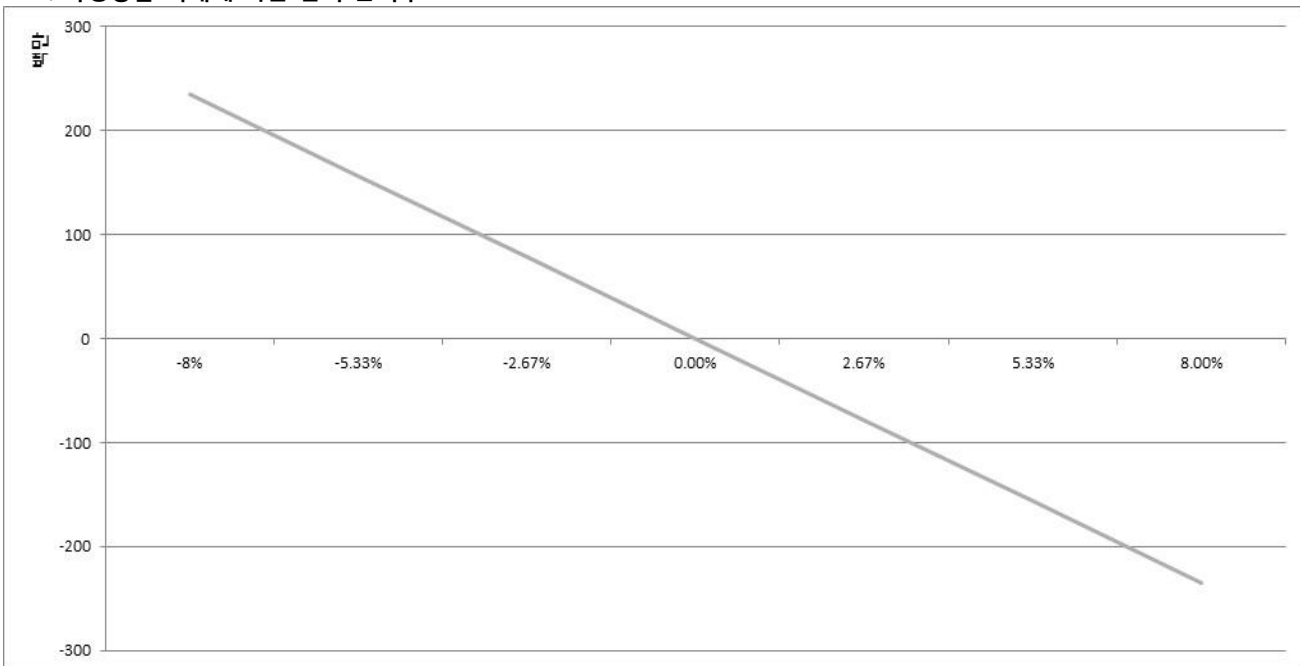
공시일: 2023-06-09

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,967	2,983	-16	장내
누계	주가지수	선물	0	2,983	-2,983	장내
신규	주식	주식	56	0	56	장내
누계	주식	주식	6,169	0	6,169	장내
합계			6,169	2,983	3,185	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

235

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

477