

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

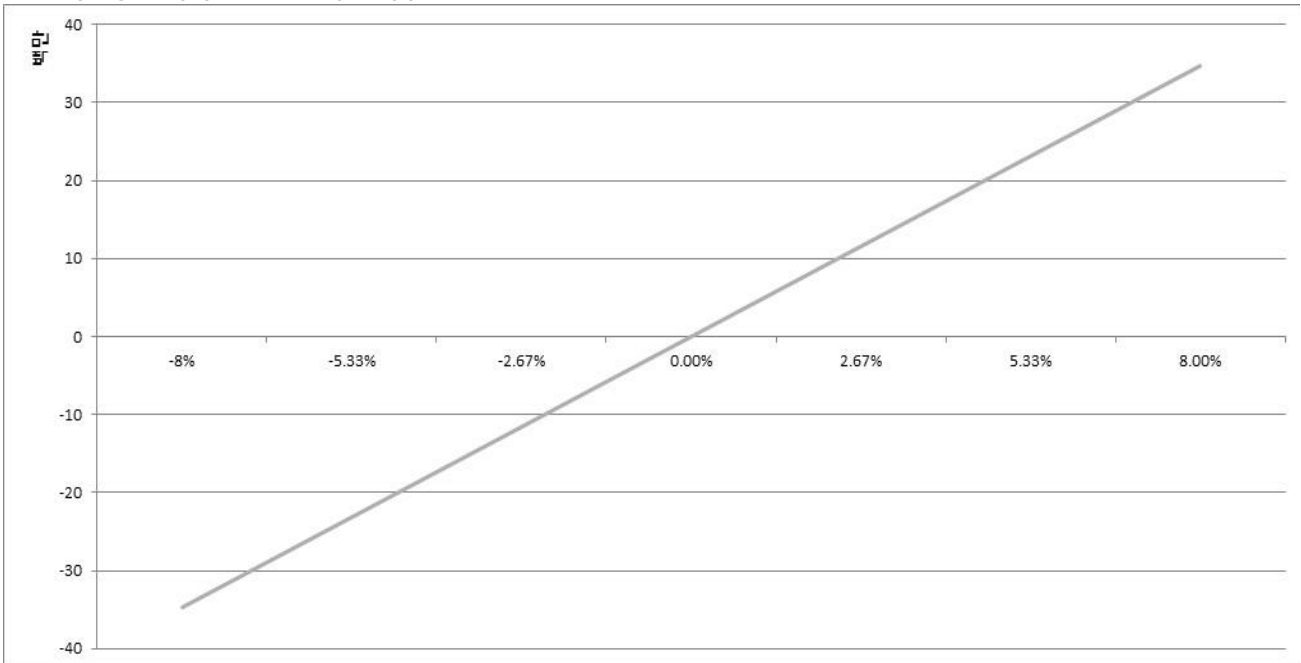
공시일: 2023-06-13

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	431	0	431	장내
신규	주식	주식	34	0	34	장내
누계	주식	주식	32,996	0	32,996	장내
신규	유가증권	선물	0	12	-12	장내
누계	유가증권	선물	0	141	-141	장내
합계			33,426	141	33,285	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

35

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,699

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

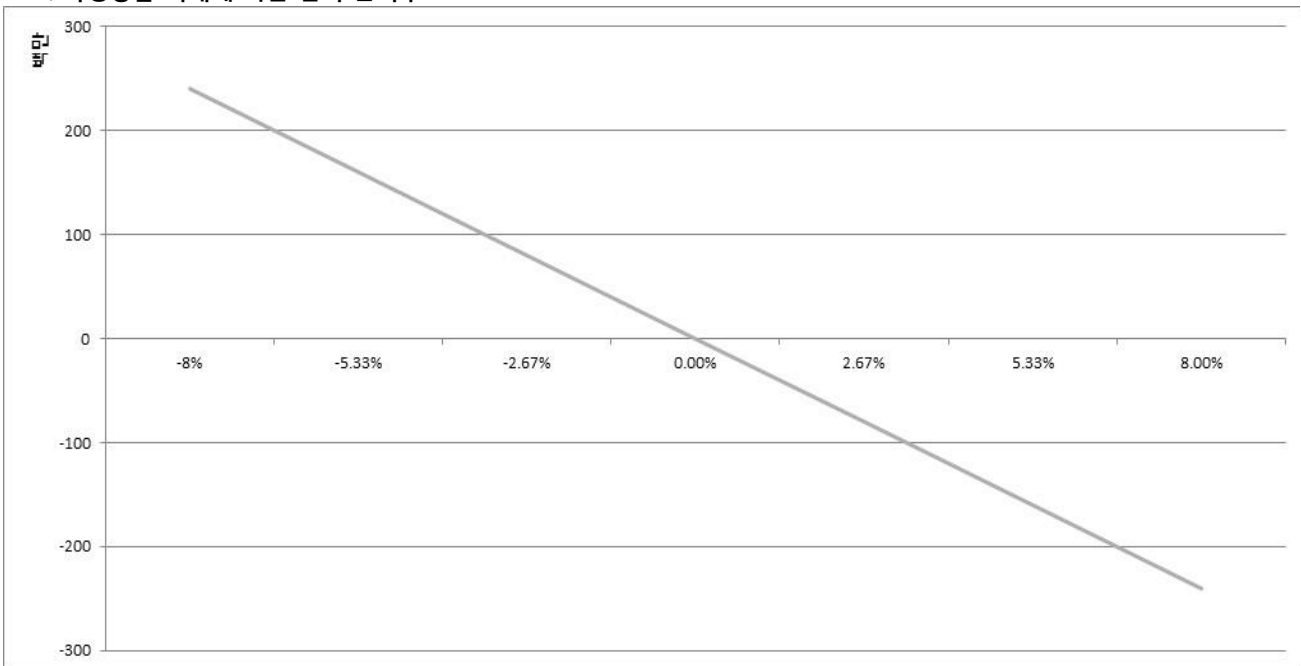
공시일: 2023-06-13

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	3,011	-3,011	장내
신규	주식	주식	57	41	15	장내
누계	주식	주식	6,288	0	6,288	장내
합계			6,288	3,011	3,277	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

241

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

533