

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

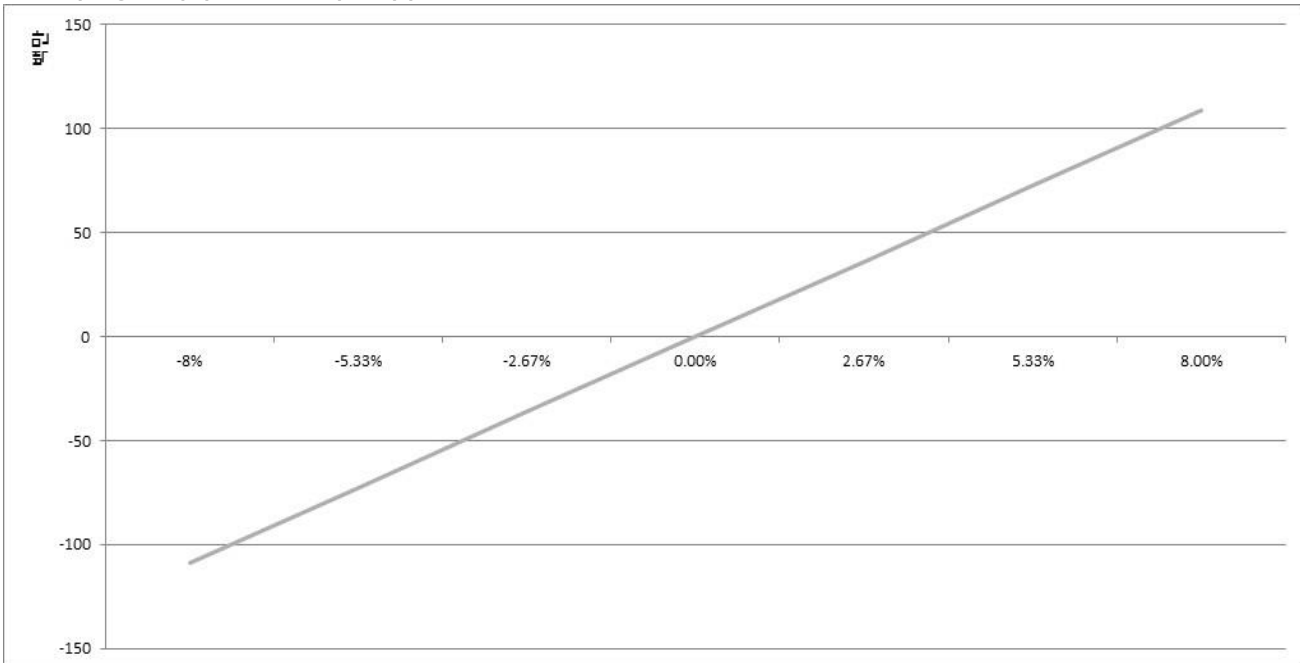
공시일: 2023-06-26

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	1,354	0	1,354	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	32,464	0	32,464	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	93	257	-163	장내
합계			33,911	257	33,655	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,573

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

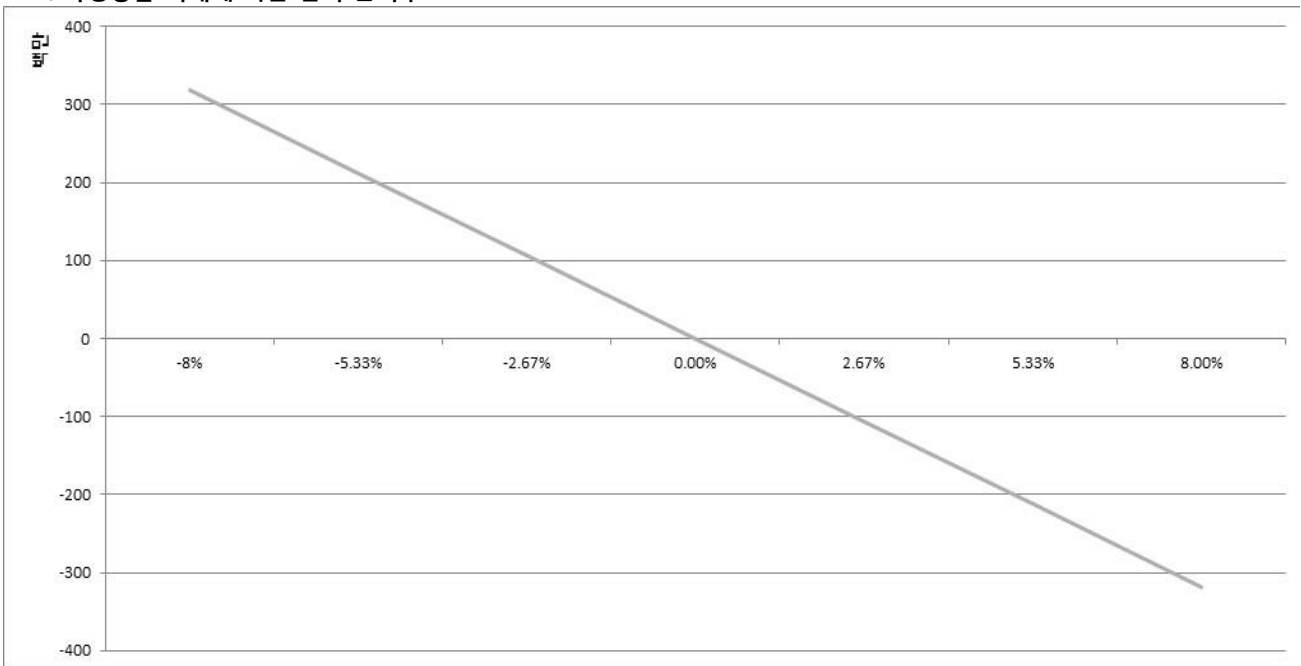
공시일: 2023-06-26

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	4,020	-4,020	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	6,173	0	6,173	장내
합계			6,173	4,020	2,152	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

318

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

444