

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

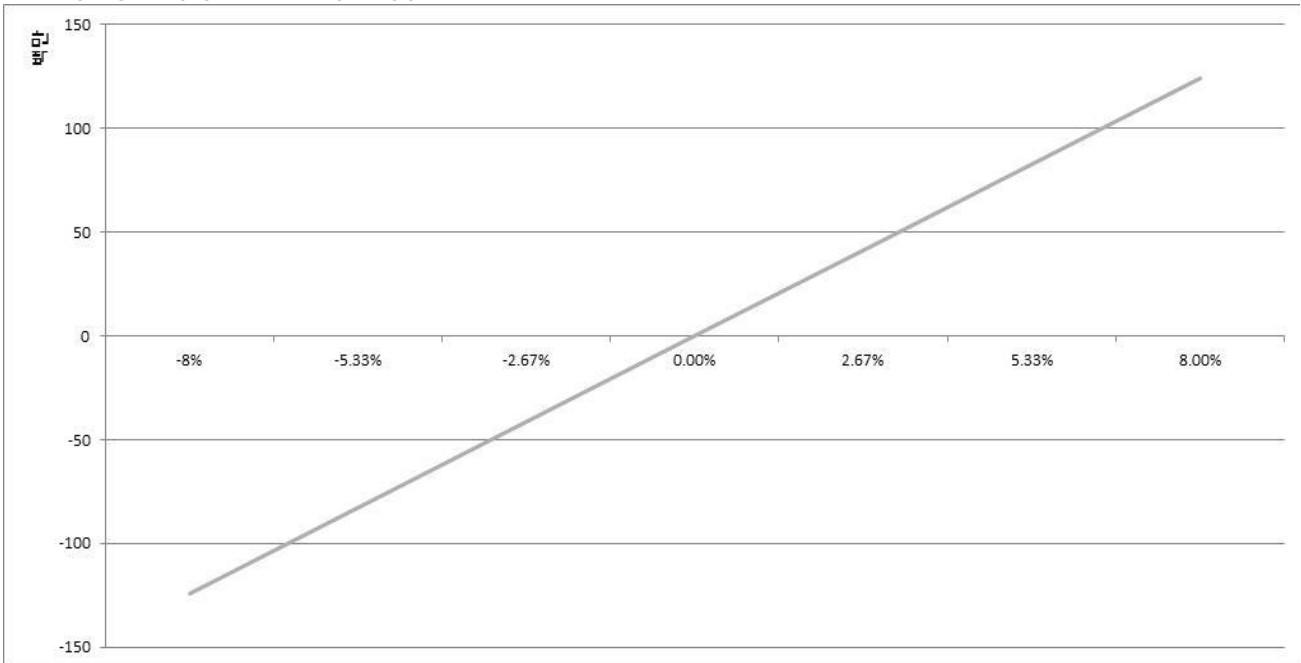
공시일: 2023-07-04

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	1,544	0	1,544	장내
신규	주식	주식	0	8	-8	장내
누계	주식	주식	32,882	0	32,882	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	111	257	-146	장내
합계			34,536	257	34,279	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

124

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,523

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

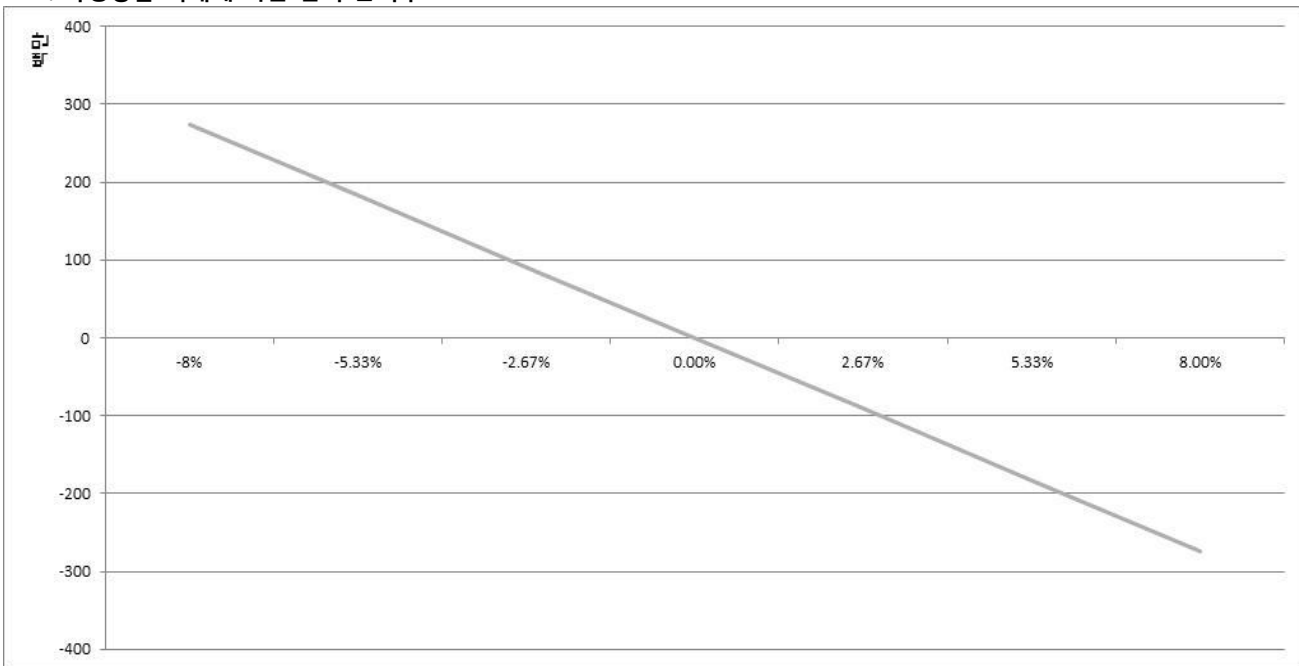
공시일: 2023-07-04

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	685	0	685	장내
누계	주가지수	선물	0	3,441	-3,441	장내
신규	주식	주식	42	8	34	장내
누계	주식	주식	6,349	0	6,349	장내
합계			6,349	3,441	2,908	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

274

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

432