

## 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2023-07-31

### 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	2,064	0	2,064	장내
신규	주식	주식	90	0	90	장내
누계	주식	주식	32,455	0	32,455	장내
신규	유가증권	선물	0	90	-90	장내
누계	유가증권	선물	393	16	377	장내
합계			34,912	16	34,896	

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

166

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,566

## 펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

공시일: 2023-07-31

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	255	0	255	장내
누계	주가지수	선물	0	3,509	-3,509	장내
신규	주식	주식	329	153	176	장내
누계	주식	주식	5,485	0	5,485	장내
합계			5,485	3,509	1,976	

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

280

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

346