

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2023-08-02

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	2,106	0	2,106	장내
신규	주식	주식	48	105	-57	장내
누계	주식	주식	33,036	0	33,036	장내
신규	유가증권	선물	62	0	62	장내
누계	유가증권	선물	481	16	465	장내
합계			35,623	16	35,607	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

169

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,626

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

공시일: 2023-08-02

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	3,616	-3,616	장내
신규	주식	주식	0	80	-80	장내
누계	주식	주식	5,592	0	5,592	장내
합계			5,592	3,616	1,975	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

288

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

349