

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

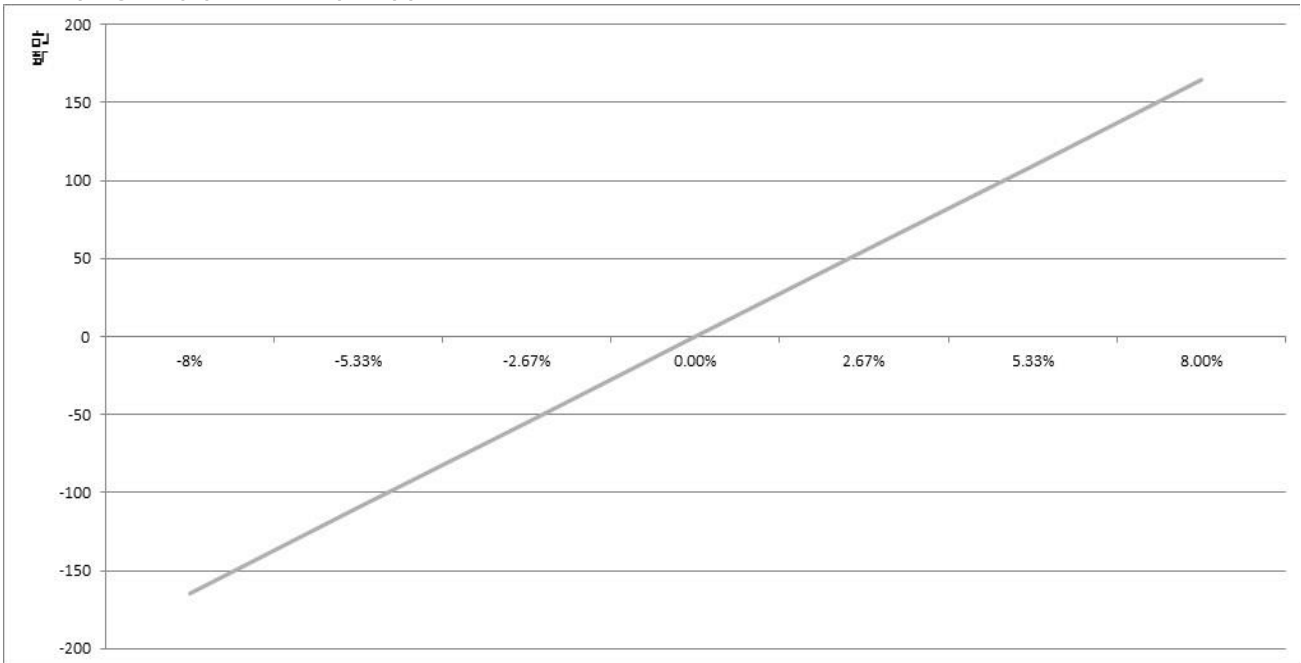
공시일: 2023-08-04

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	2,049	0	2,049	장내
신규	주식	주식	10	0	10	장내
누계	주식	주식	32,153	0	32,153	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	467	16	451	장내
합계			34,669	16	34,653	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

164

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,558

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

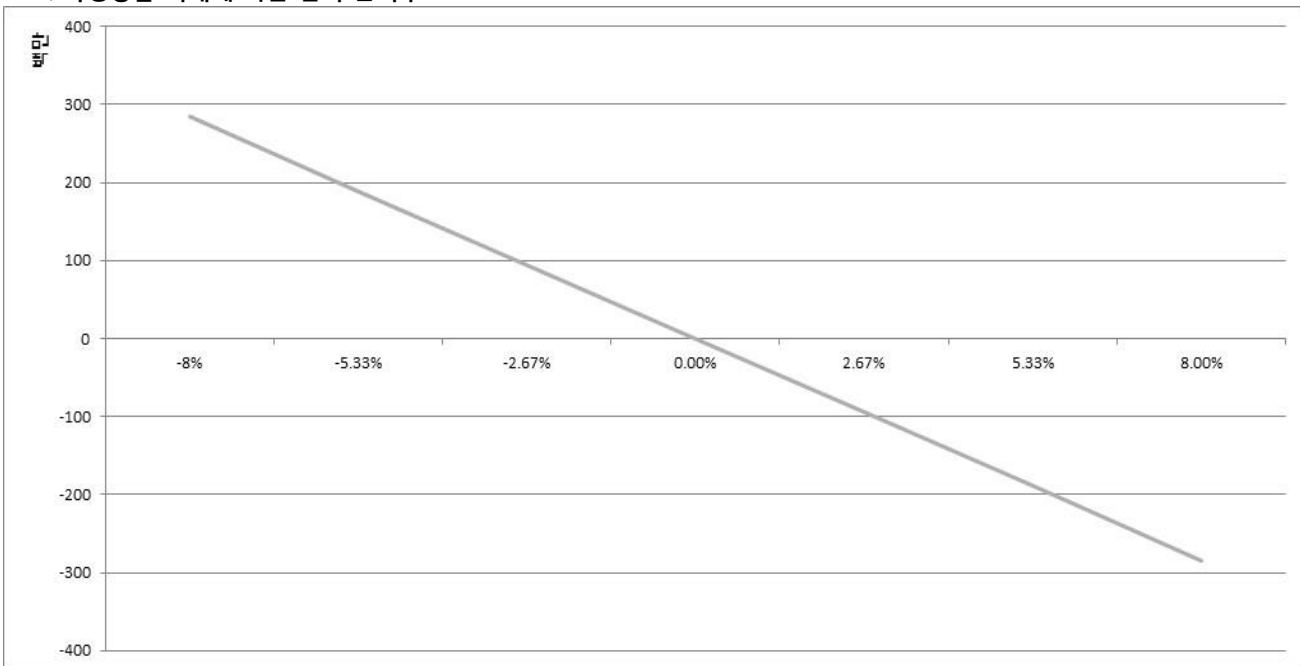
공시일: 2023-08-04

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	0	3,555	-3,555	장내
신규	주식	주식	209	27	183	장내
누계	주식	주식	5,446	0	5,446	장내
합계			5,446	3,555	1,891	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

284

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

329