

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

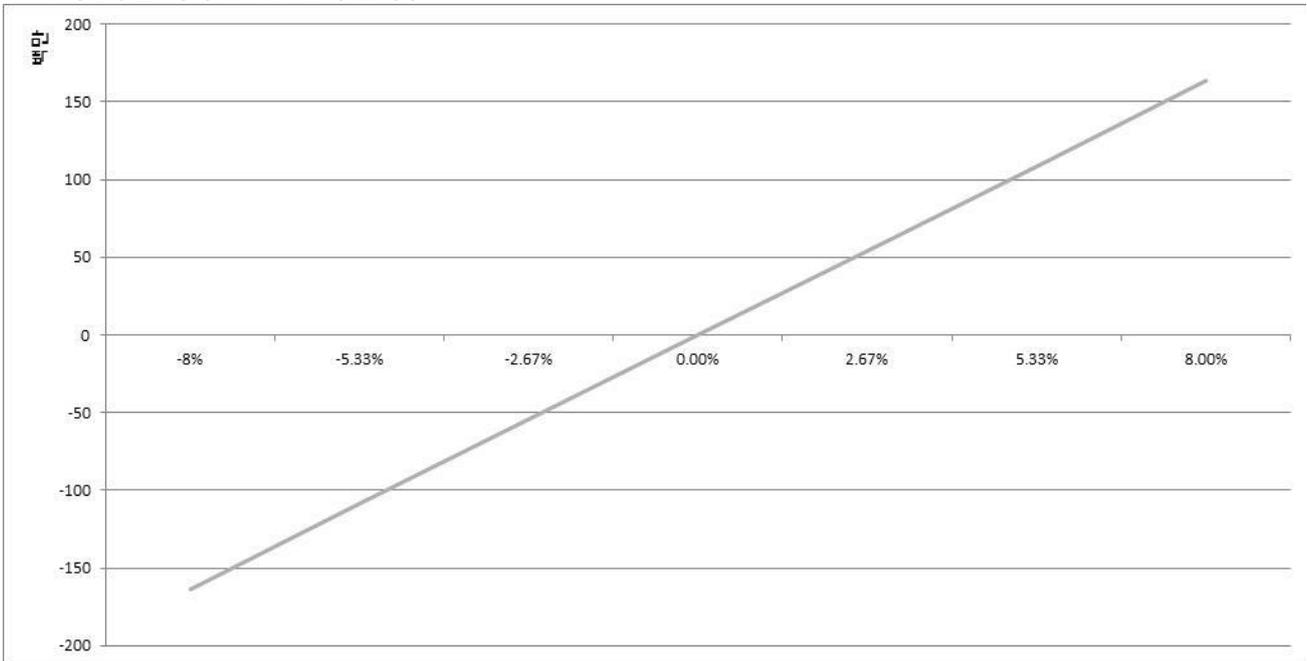
공시일: 2023-08-11

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	2,043	0	2,043	장내
신규	주식	주식	385	64	321	장내
누계	주식	주식	32,354	0	32,354	장내
신규	유가증권	선물	161	482	-320	장내
누계	유가증권	선물	161	16	145	장내
합계			34,558	16	34,542	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

163

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,540

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

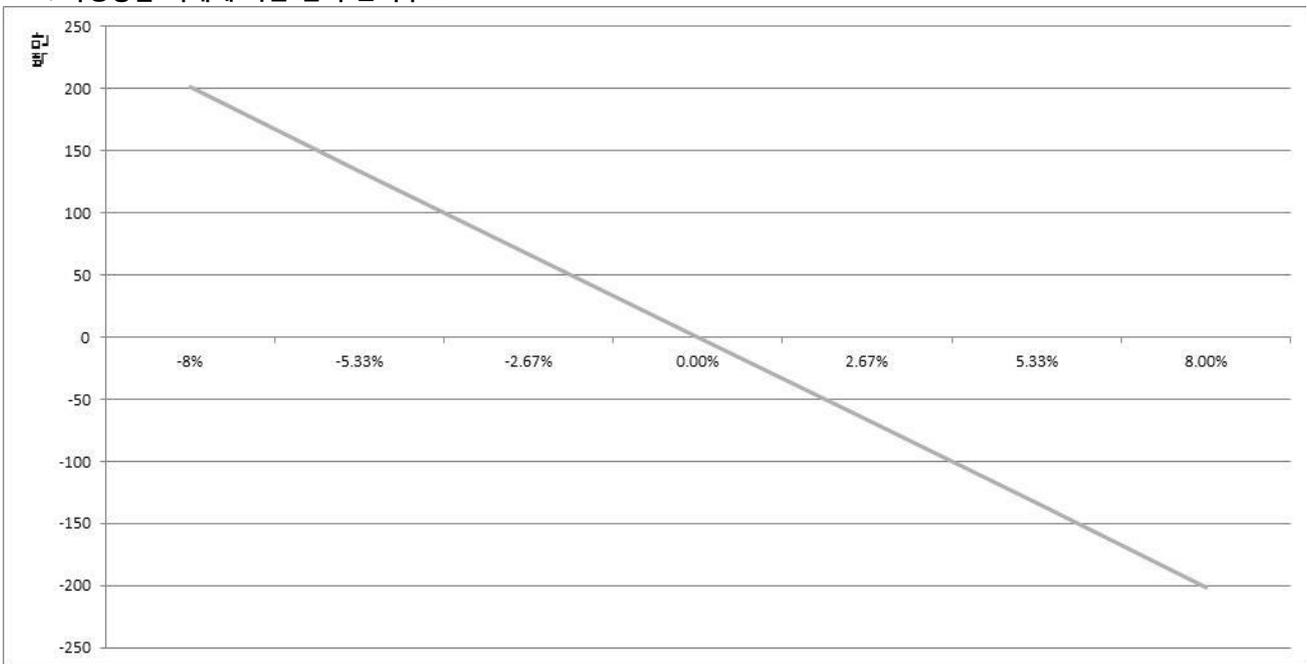
공시일: 2023-08-11

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	931	0	931	장내
누계	주가지수	선물	0	2,527	-2,527	장내
신규	주식	주식	1,038	975	64	장내
누계	주식	주식	4,841	0	4,841	장내
합계			4,841	2,527	2,314	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

201

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

286