

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

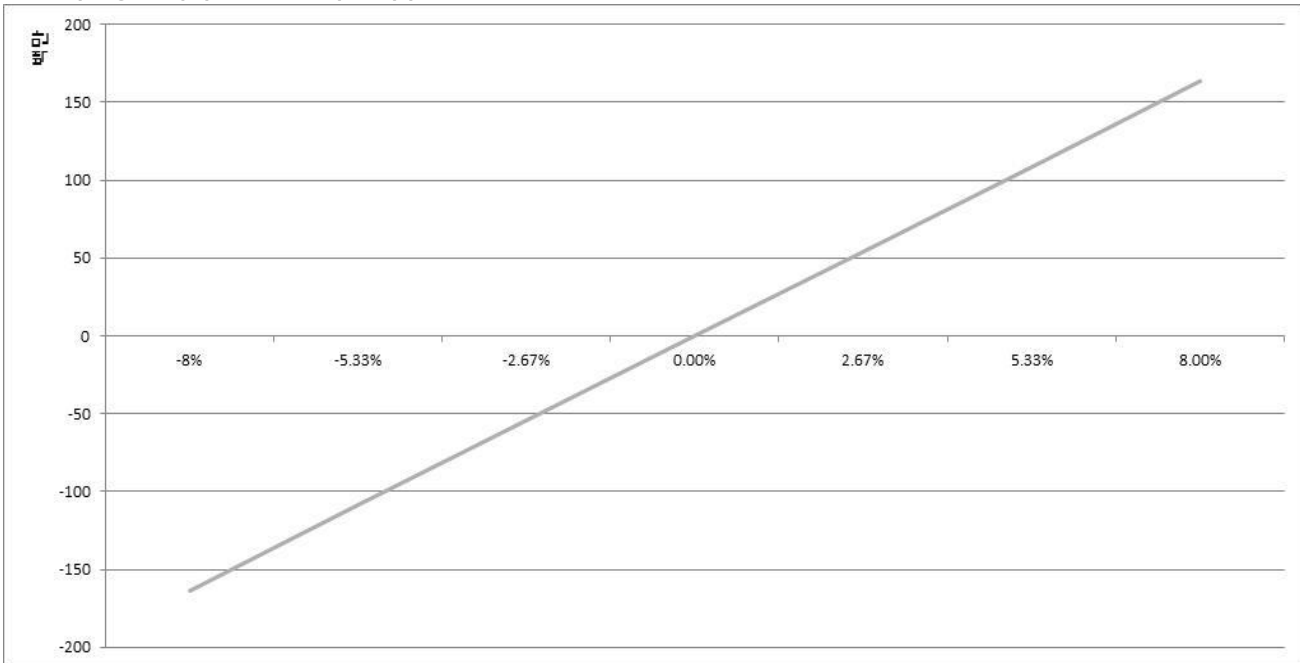
공시일: 2023-08-14

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	2,034	0	2,034	장내
신규	주식	주식	14	78	-64	장내
누계	주식	주식	32,154	0	32,154	장내
신규	유가증권	선물	78	0	78	장내
누계	유가증권	선물	175	16	159	장내
합계			34,362	16	34,346	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

163

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,547

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

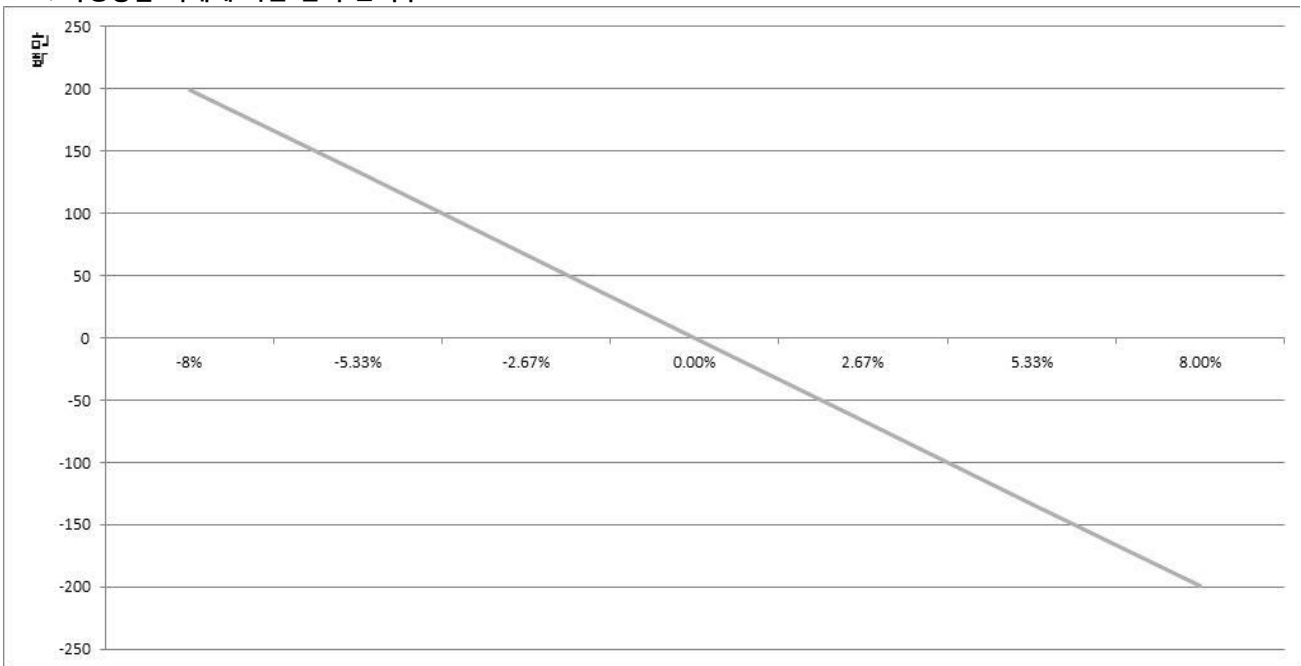
공시일: 2023-08-14

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	2,503	-2,503	장내
신규	주식	주식	119	0	119	장내
누계	주식	주식	5,025	0	5,025	장내
합계			5,025	2,503	2,522	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

199

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

304