

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

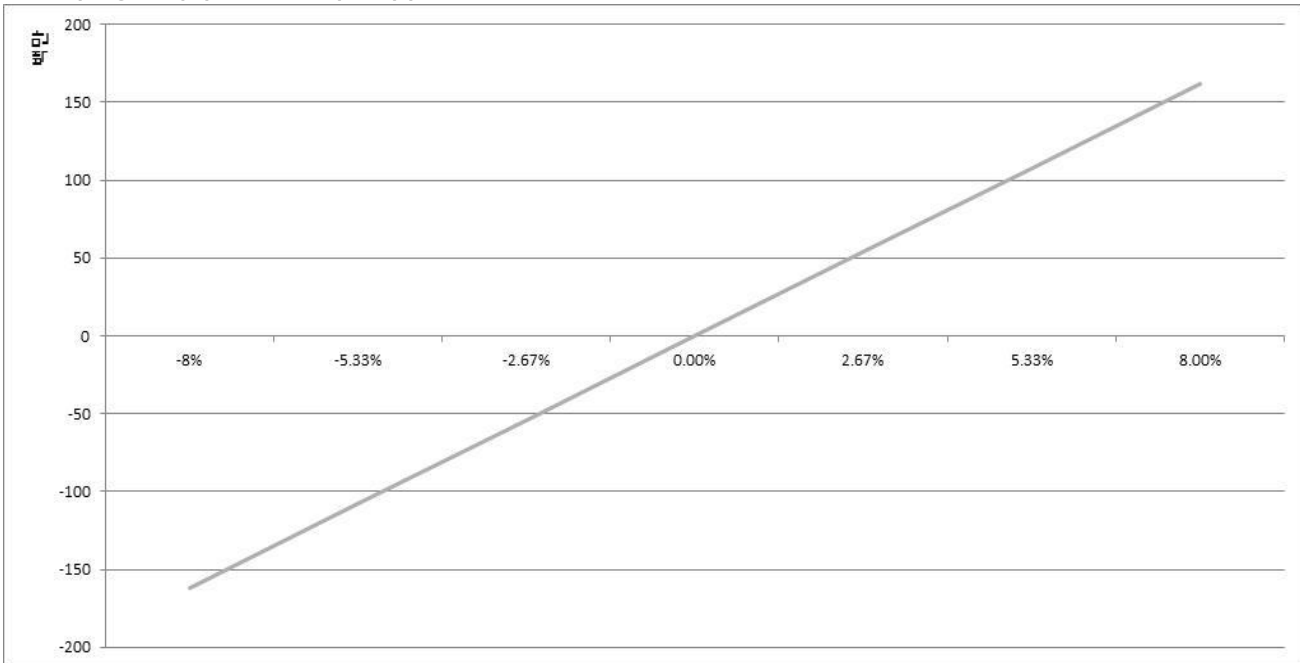
공시일: 2023-08-16

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	2,018	0	2,018	장내
신규	주식	주식	0	427	-427	장내
누계	주식	주식	31,476	0	31,476	장내
신규	유가증권	선물	427	0	427	장내
누계	유가증권	선물	603	16	587	장내
합계			34,097	16	34,081	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

162

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,534

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

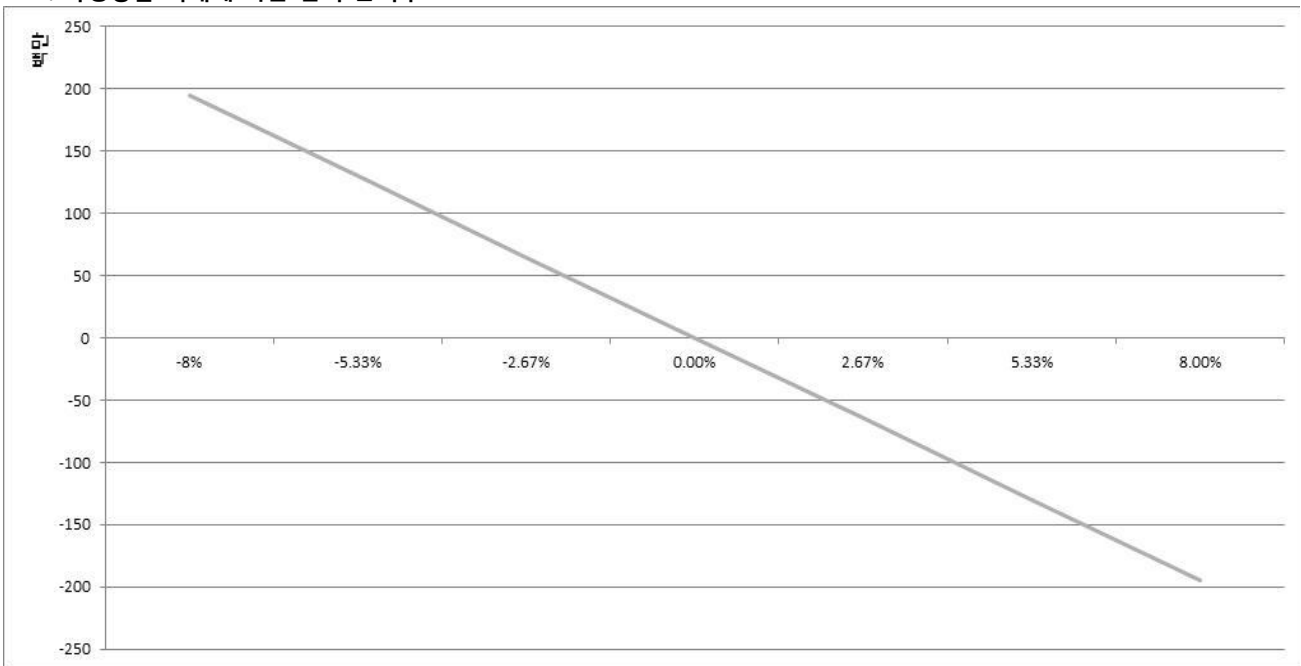
공시일: 2023-08-16

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	2,458	-2,458	장내
신규	주식	주식	17	2	15	장내
누계	주식	주식	4,989	0	4,989	장내
합계			4,989	2,458	2,531	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

195

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

266