

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

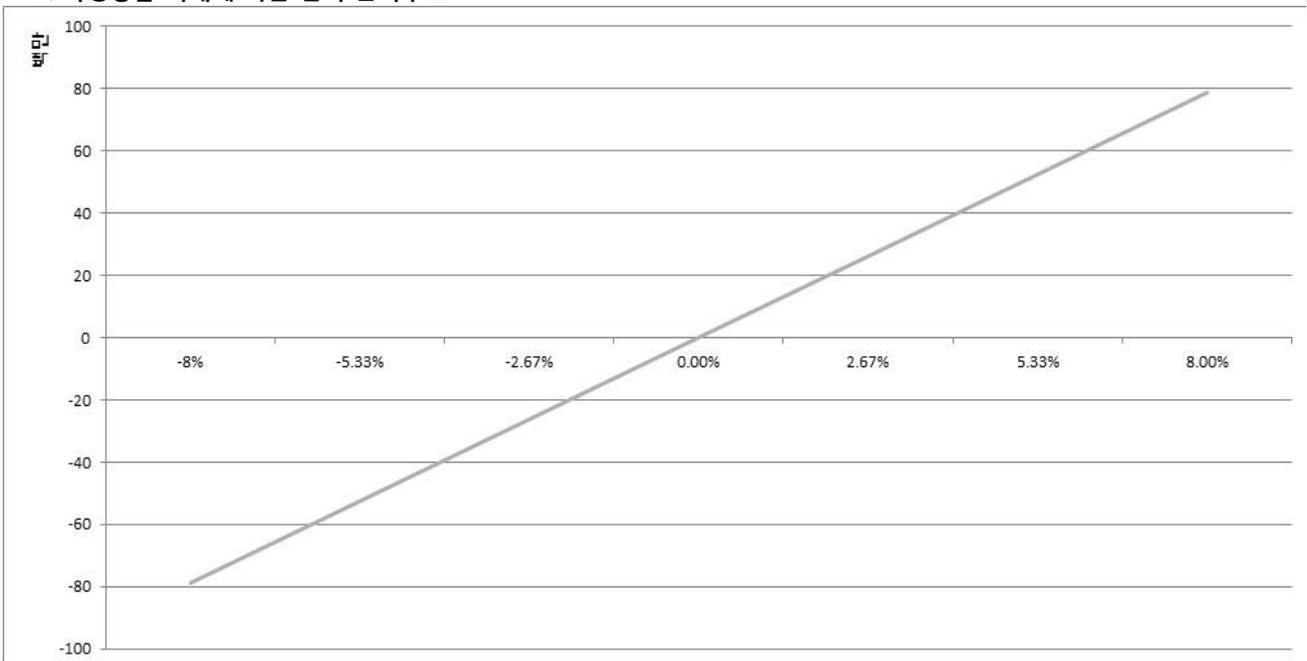
공시일: 2023-08-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	987	-987	장내
누계	주가지수	선물	987	0	987	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	30,641	0	30,641	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	731	16	715	장내
합계			32,359	16	32,343	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

79

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,435

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

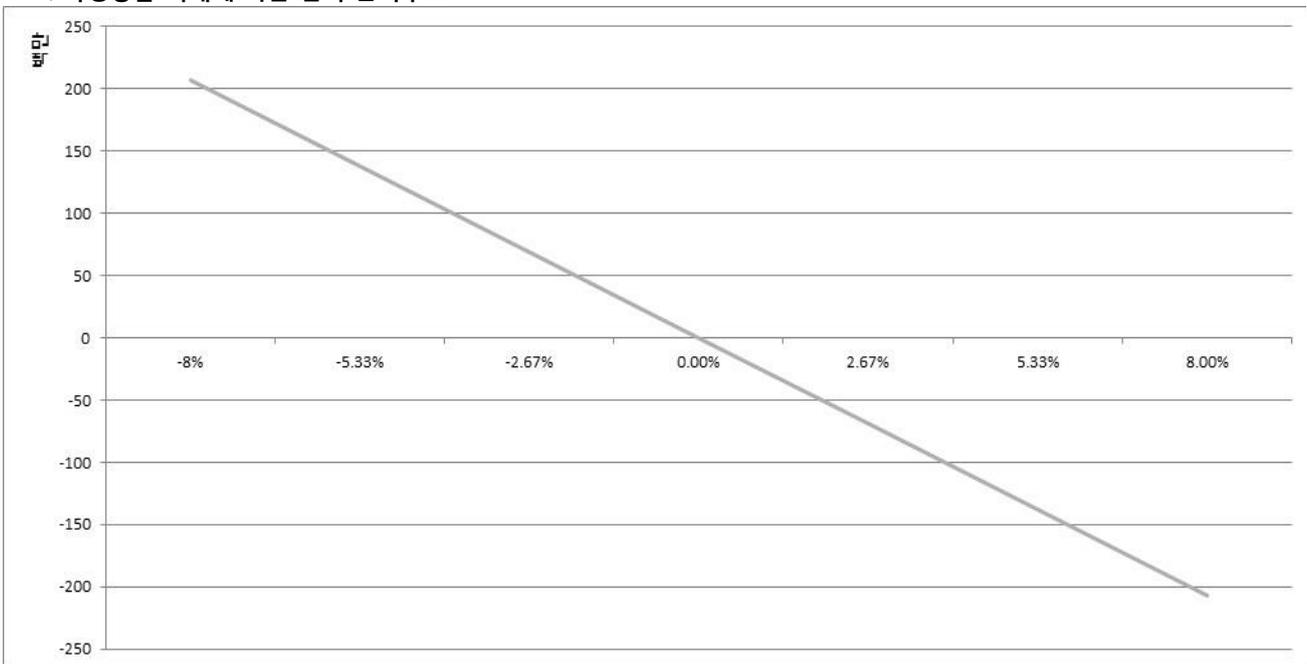
공시일: 2023-08-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	130	-130	장내
누계	주가지수	선물	0	2,590	-2,590	장내
신규	주식	주식	102	0	102	장내
누계	주식	주식	5,074	0	5,074	장내
합계			5,074	2,590	2,484	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

207

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

294