

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

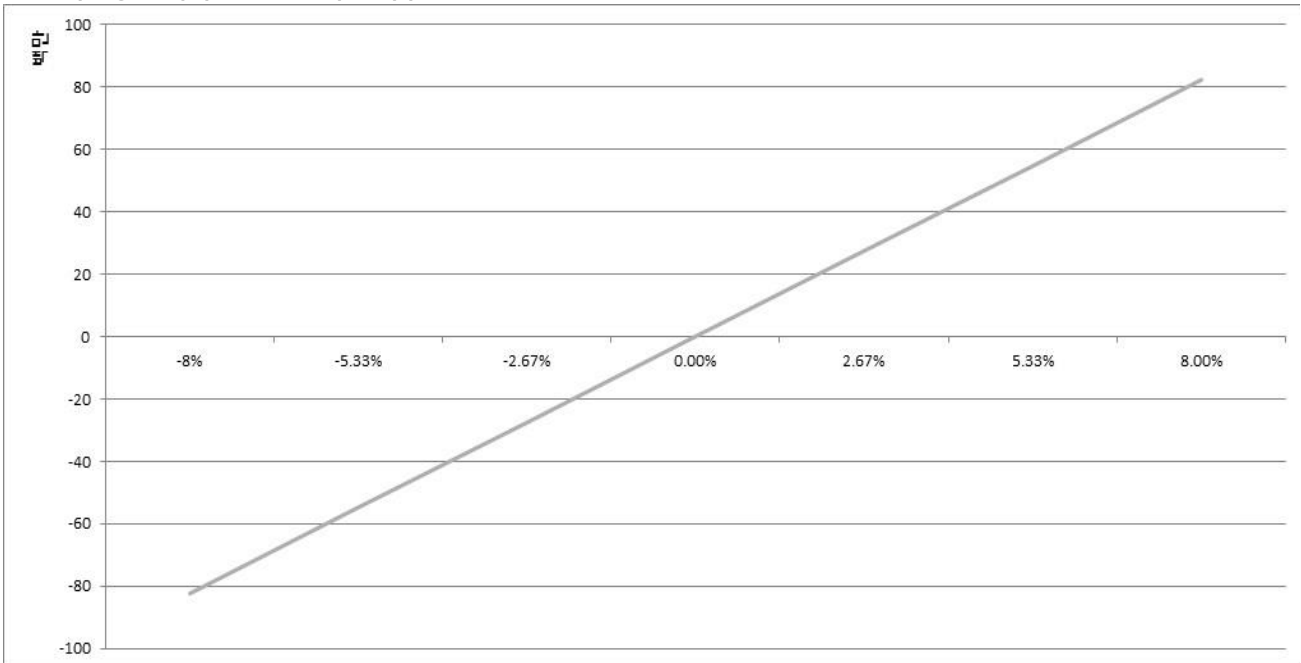
공시일: 2023-09-19

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	1,022	0	1,022	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	33,408	0	33,408	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	48	902	-853	장내
합계			34,478	902	33,577	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

82

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,441

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

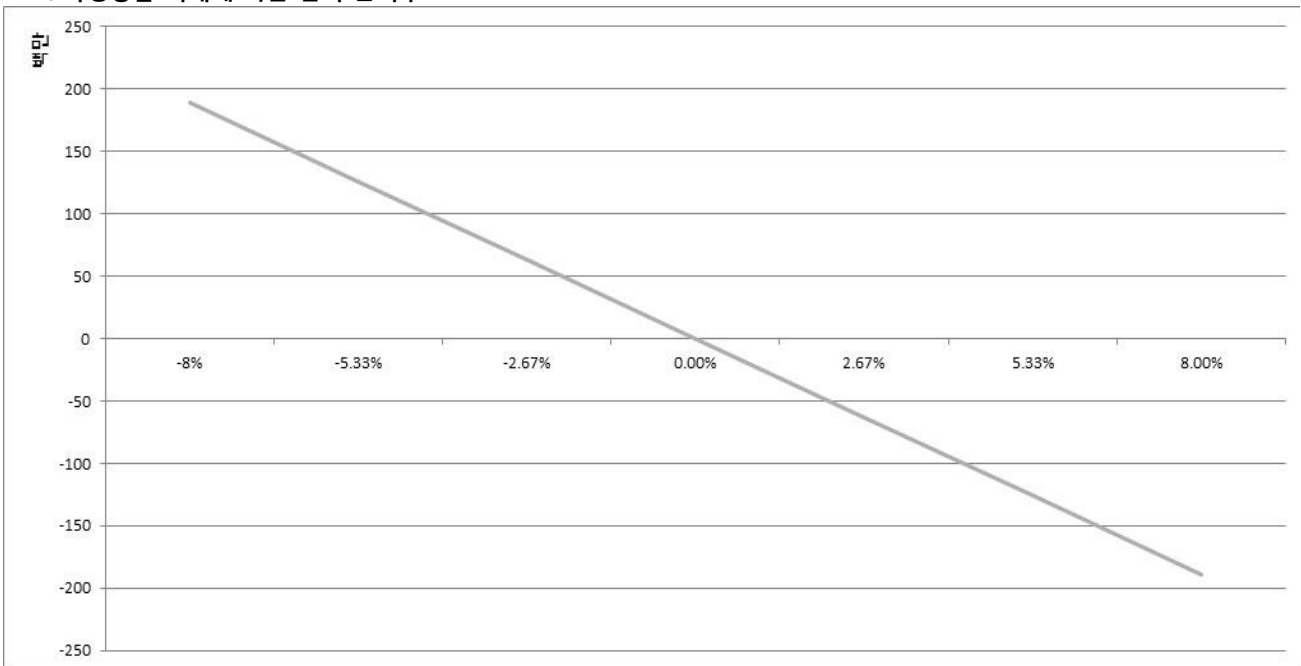
공시일: 2023-09-19

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	2,372	-2,372	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	4,900	0	4,900	장내
합계			4,900	2,372	2,528	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

189

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

298