

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

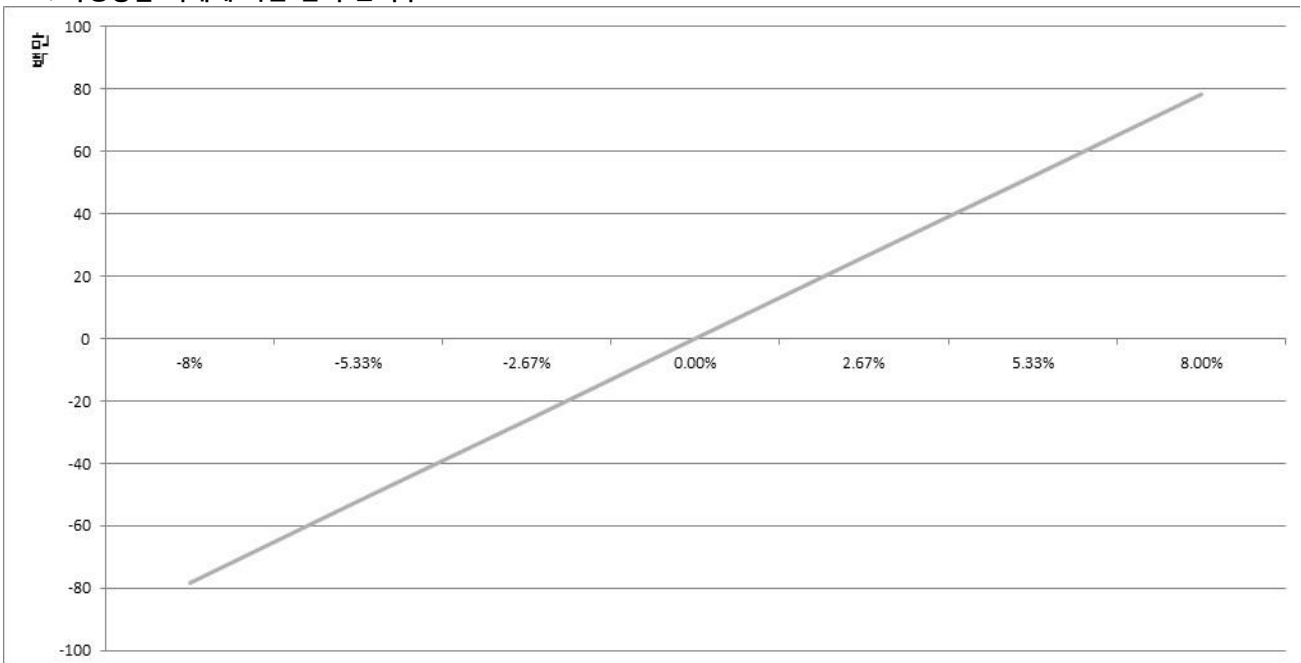
공시일: 2023-11-10

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	976	0	976	장내
신규	주식	주식	2,163	134	2,029	장내
누계	주식	주식	30,948	0	30,948	장내
신규	유가증권	선물	134	2,161	-2,027	장내
누계	유가증권	선물	167	0	167	장내
합계			32,091	0	32,091	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

78

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,287

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

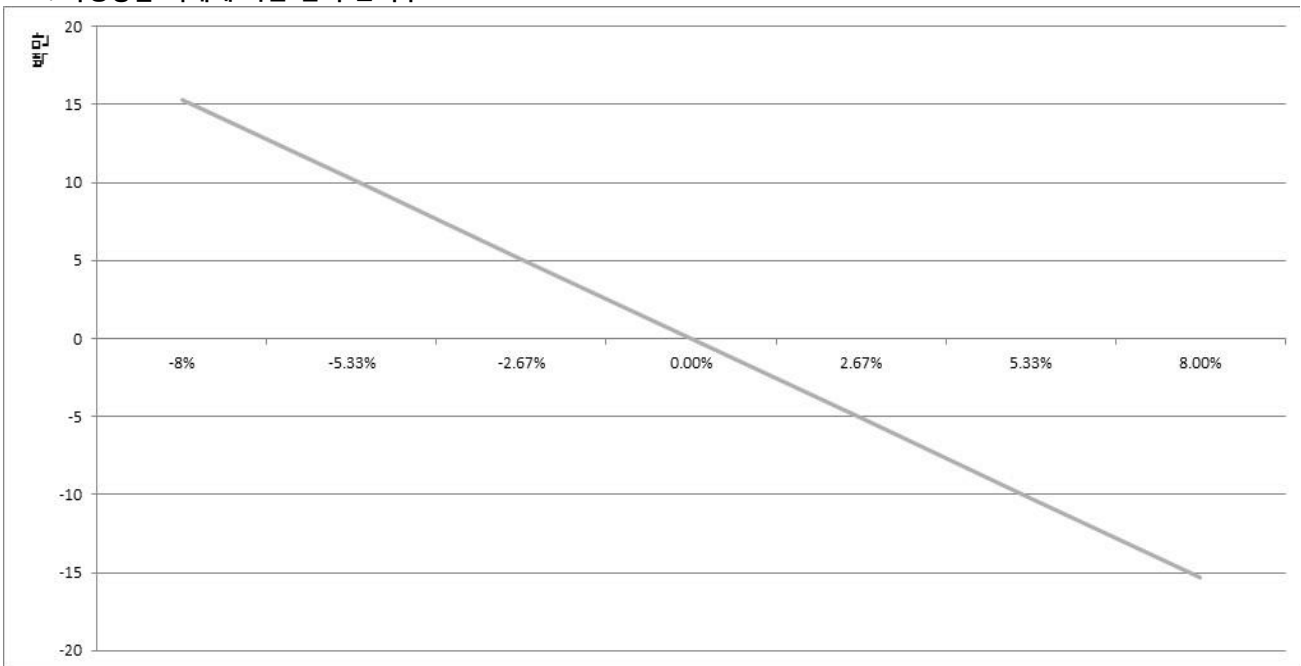
공시일: 2023-11-10

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	192	-192	장내
신규	주식	주식	94	7	87	장내
누계	주식	주식	4,839	0	4,839	장내
합계			4,839	192	4,647	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

15

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

622