

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

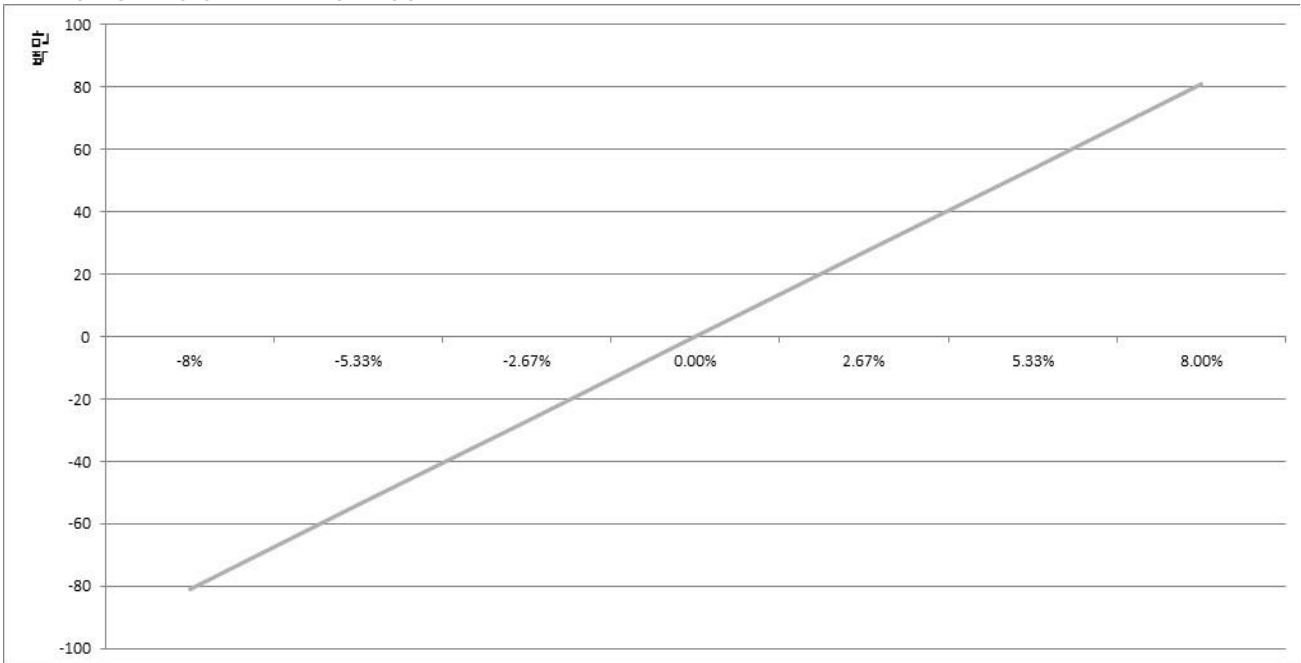
공시일: 2023-11-22

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	1,010	0	1,010	장내
신규	주식	주식	5	170	-164	장내
누계	주식	주식	31,087	0	31,087	장내
신규	유가증권	선물	164	0	164	장내
누계	유가증권	선물	1,108	0	1,108	장내
합계			33,205	0	33,205	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

81

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,339

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

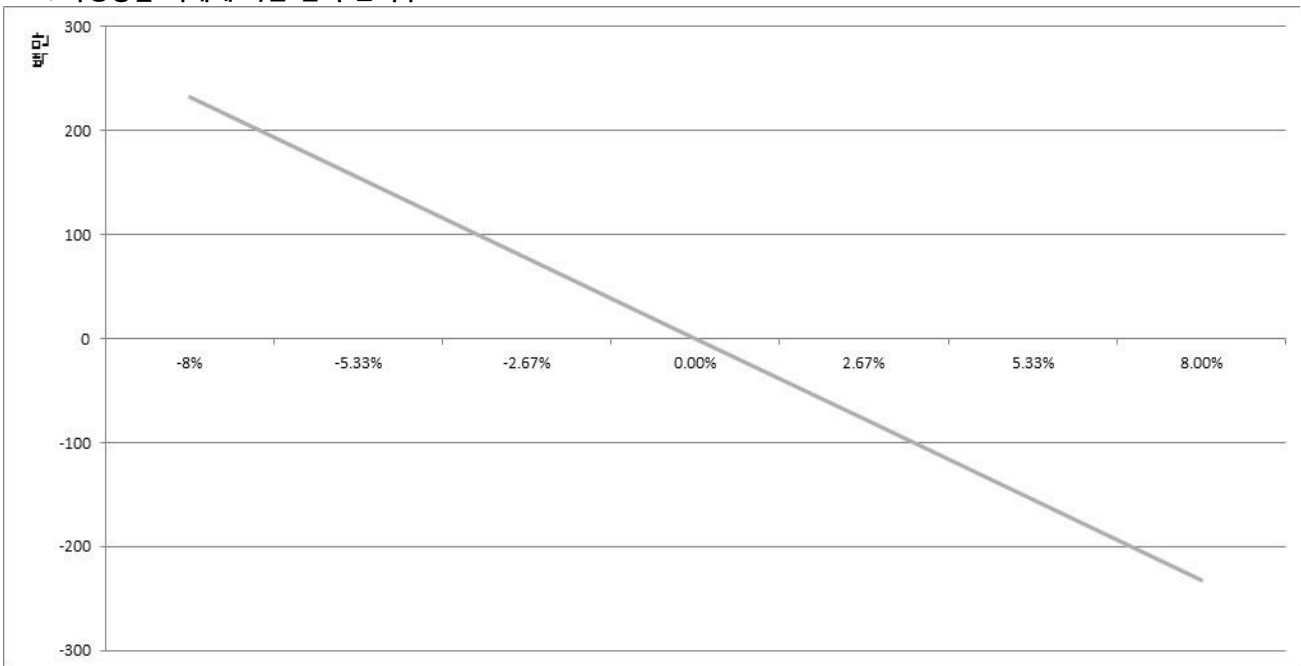
공시일: 2023-11-22

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	0	323	-323	장내
누계	주가지수	선물	0	2,918	-2,918	장내
신규	주식	주식	150	144	5	장내
누계	주식	주식	4,296	0	4,296	장내
합계			4,296	2,918	1,378	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

232

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

242