

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

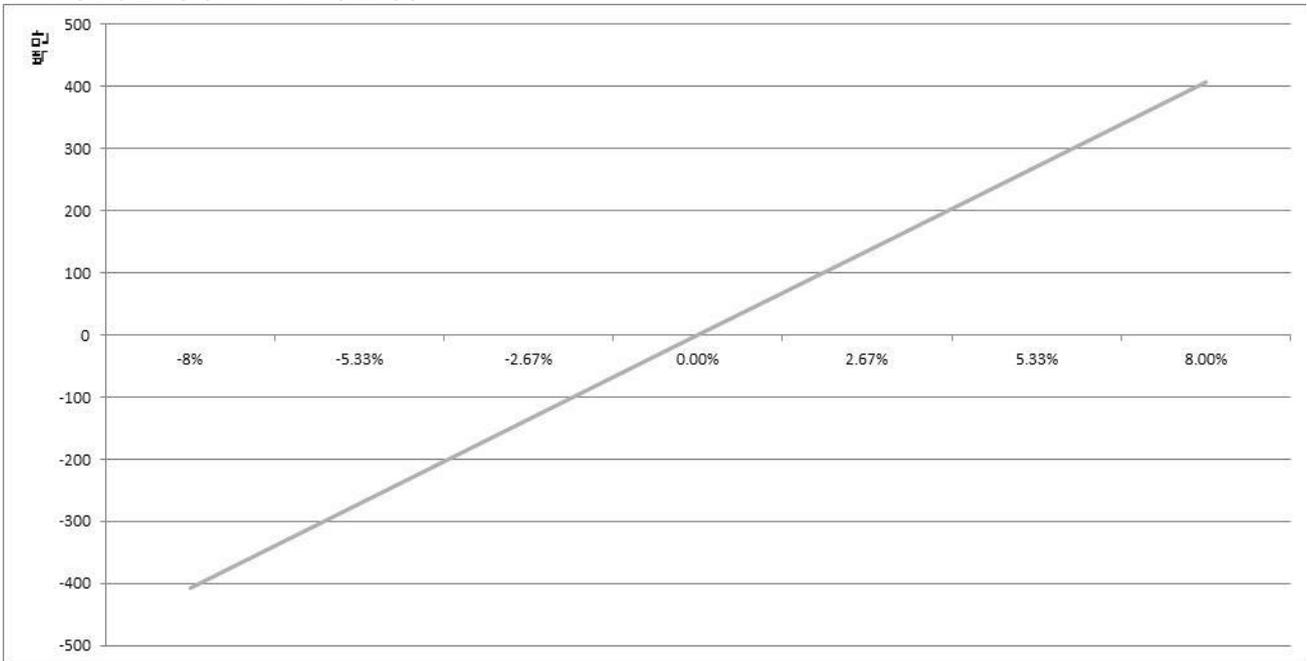
공시일: 2023-12-01

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	5,076	0	5,076	장내
신규	주식	주식	0	87	-87	장내
누계	주식	주식	30,759	0	30,759	장내
신규	유가증권	선물	87	0	87	장내
누계	유가증권	선물	1,604	0	1,604	장내
합계			37,439	0	37,439	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

407

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,475

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

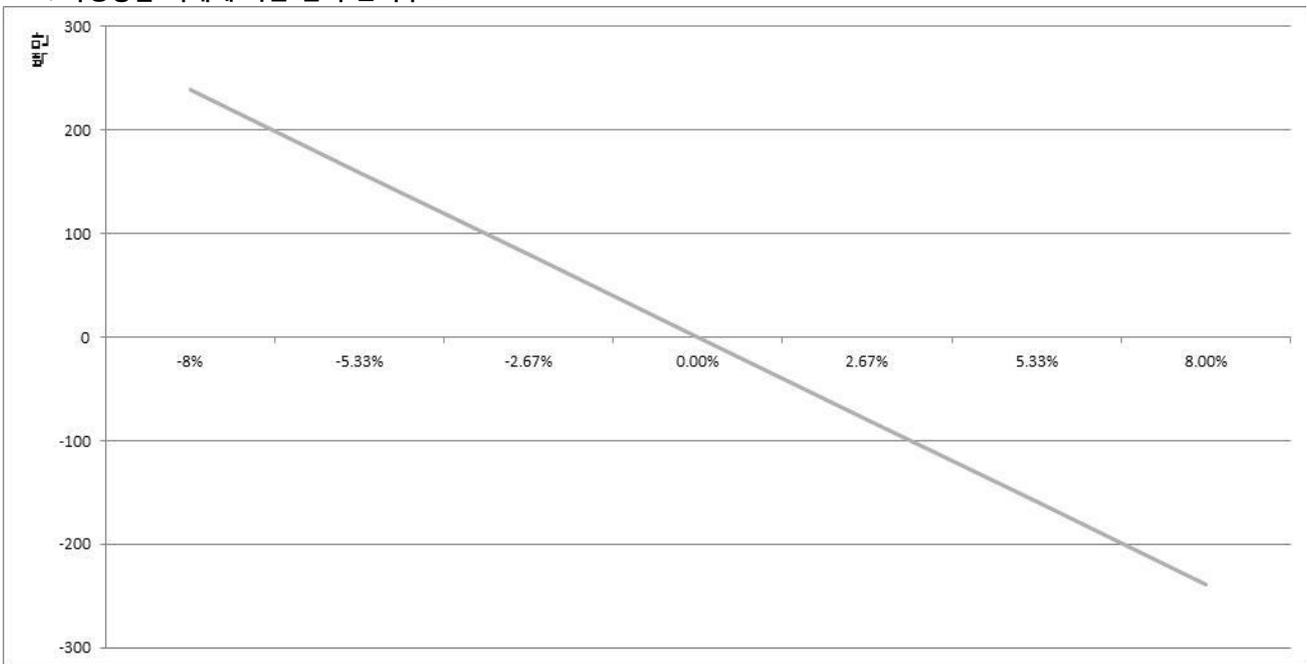
공시일: 2023-12-01

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	2,992	-2,992	장내
신규	주식	주식	2	0	2	장내
누계	주식	주식	4,444	0	4,444	장내
합계			4,444	2,992	1,452	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

238

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

254