

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

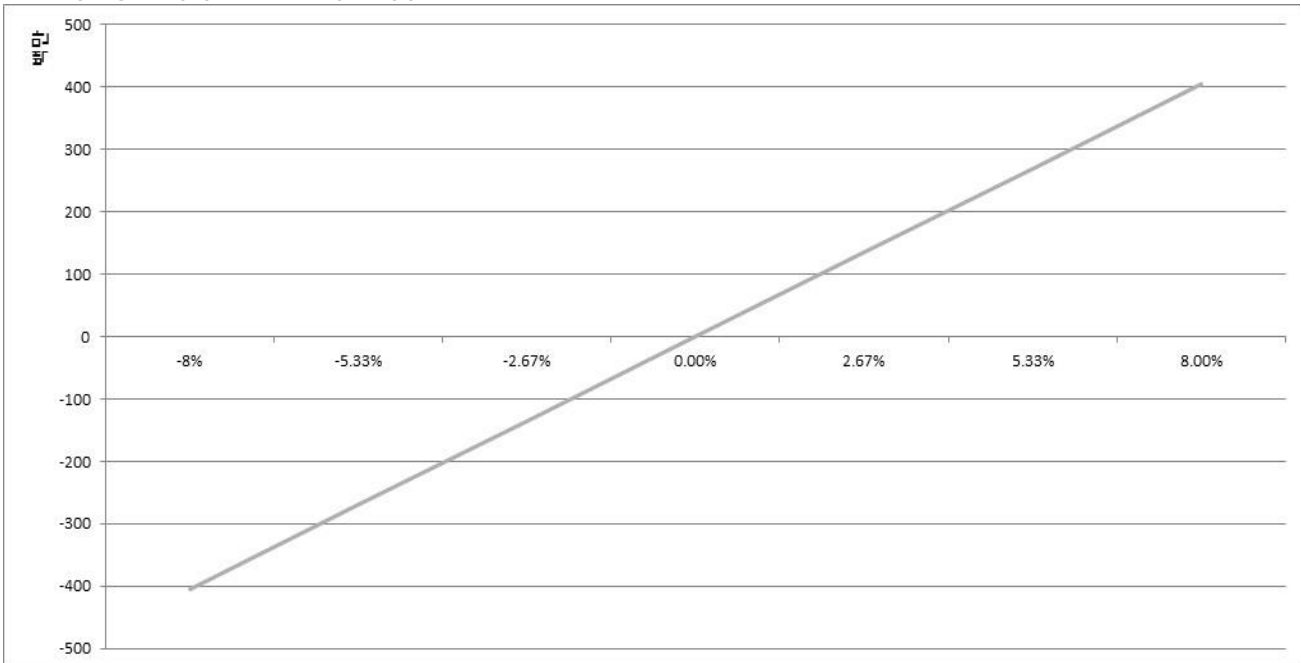
공시일: 2023-12-11

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	5,049	0	5,049	장내
신규	주식	주식	0	136	-136	장내
누계	주식	주식	30,909	0	30,909	장내
신규	유가증권	선물	133	0	133	장내
누계	유가증권	선물	1,284	0	1,284	장내
합계			37,241	0	37,241	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

405

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,416

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

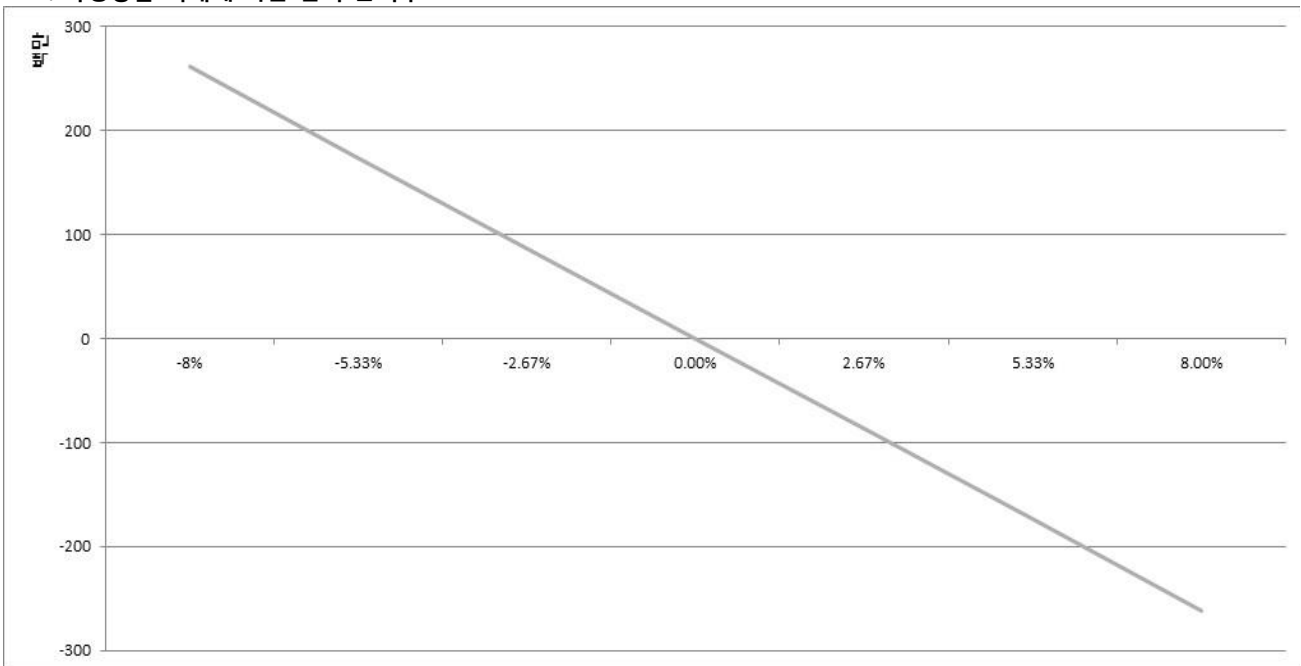
공시일: 2023-12-11

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	3,260	-3,260	장내
신규	주식	주식	0	3	-3	장내
누계	주식	주식	4,385	0	4,385	장내
합계			4,385	3,260	1,125	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

261

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

217