

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

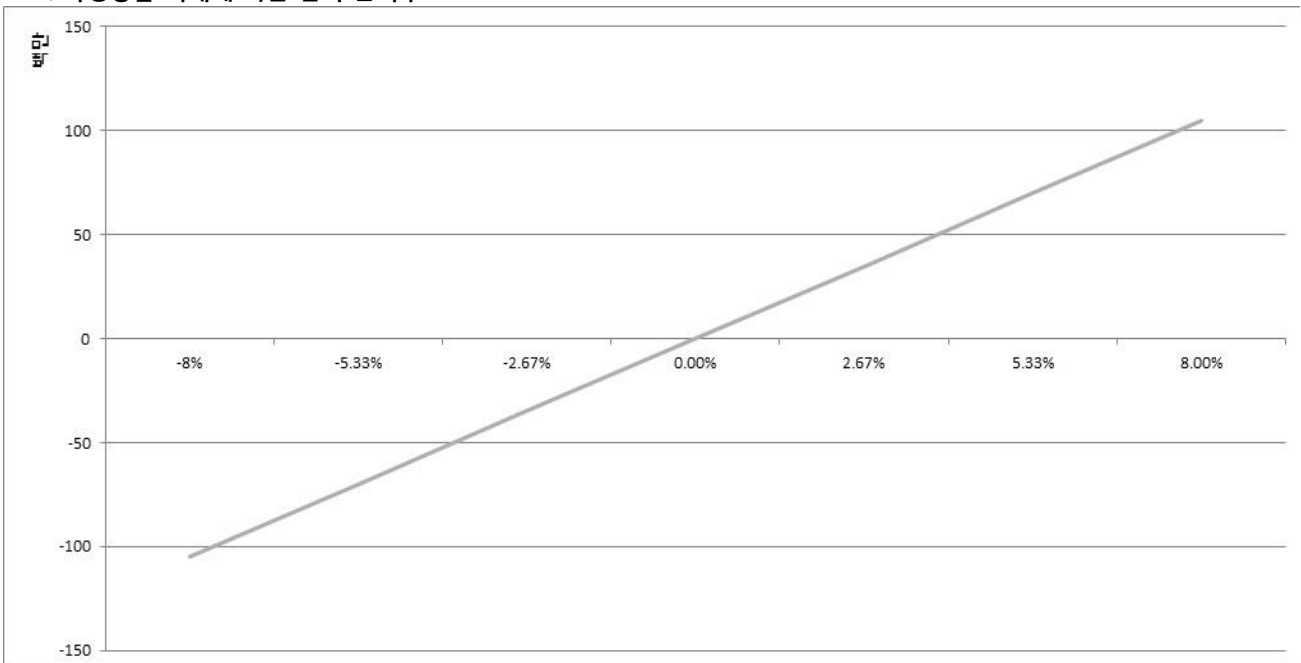
공시일: 2023-12-22

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	1,308	0	1,308	장내
신규	주식	주식	0	86	-86	장내
누계	주식	주식	36,275	0	36,275	장내
신규	유가증권	선물	86	0	86	장내
누계	유가증권	선물	1,017	0	1,017	장내
합계			38,600	0	38,600	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

105

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,727

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

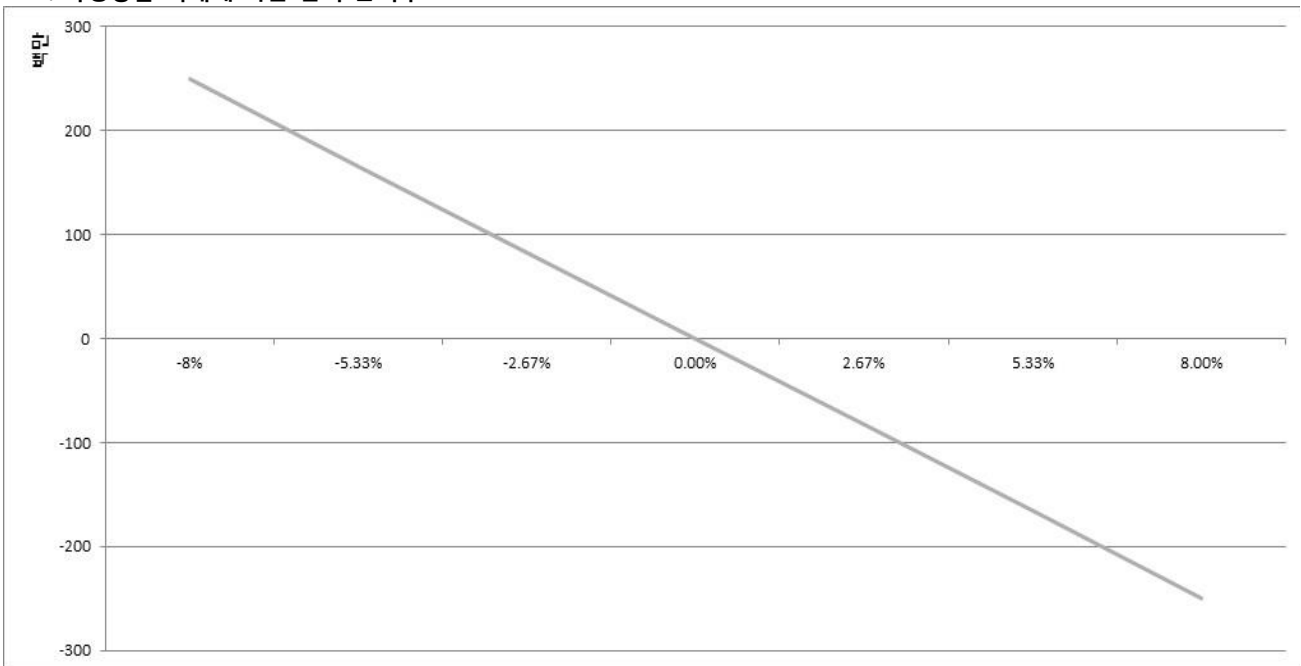
공시일: 2023-12-22

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	0	3,136	-3,136	장내
신규	주식	주식	0	115	-115	장내
누계	주식	주식	4,421	0	4,421	장내
합계			4,421	3,136	1,285	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

249

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

269