

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

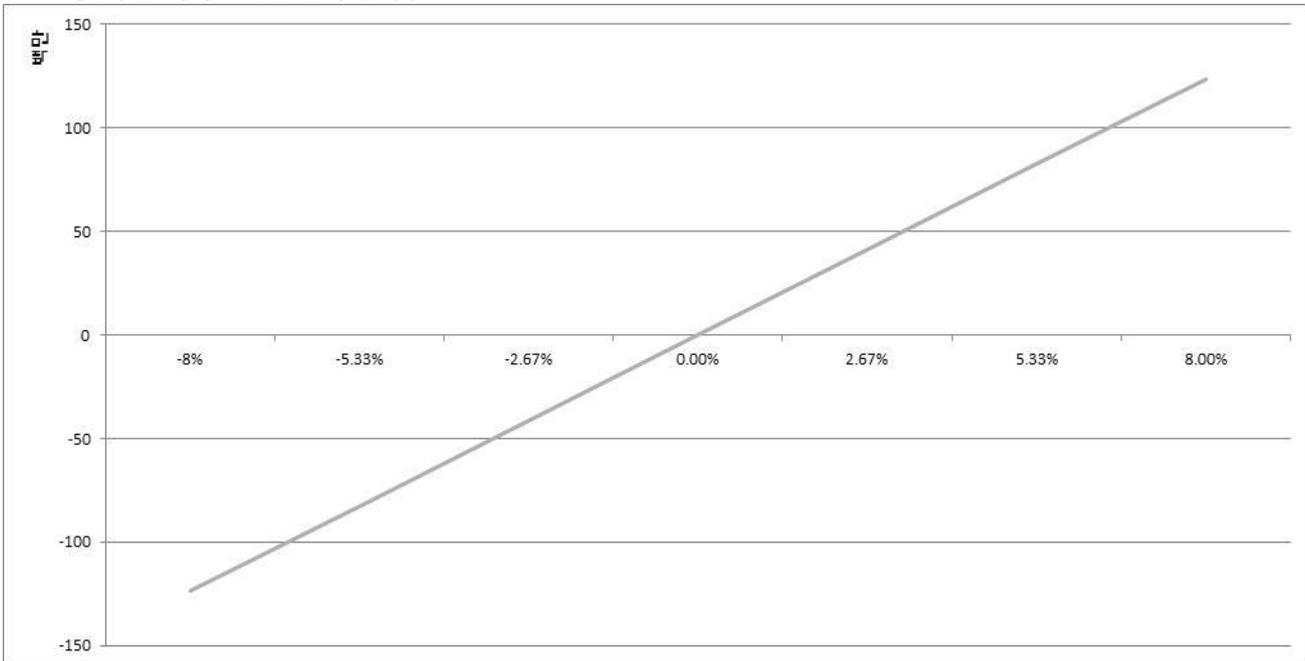
공시일: 2024-01-12

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	1,531	0	1,531	장내
신규	주식	주식	619	154	465	장내
누계	주식	주식	36,220	0	36,220	장내
신규	유가증권	선물	154	619	-465	장내
누계	유가증권	선물	154	0	154	장내
합계			37,905	0	37,905	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

124

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,557

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

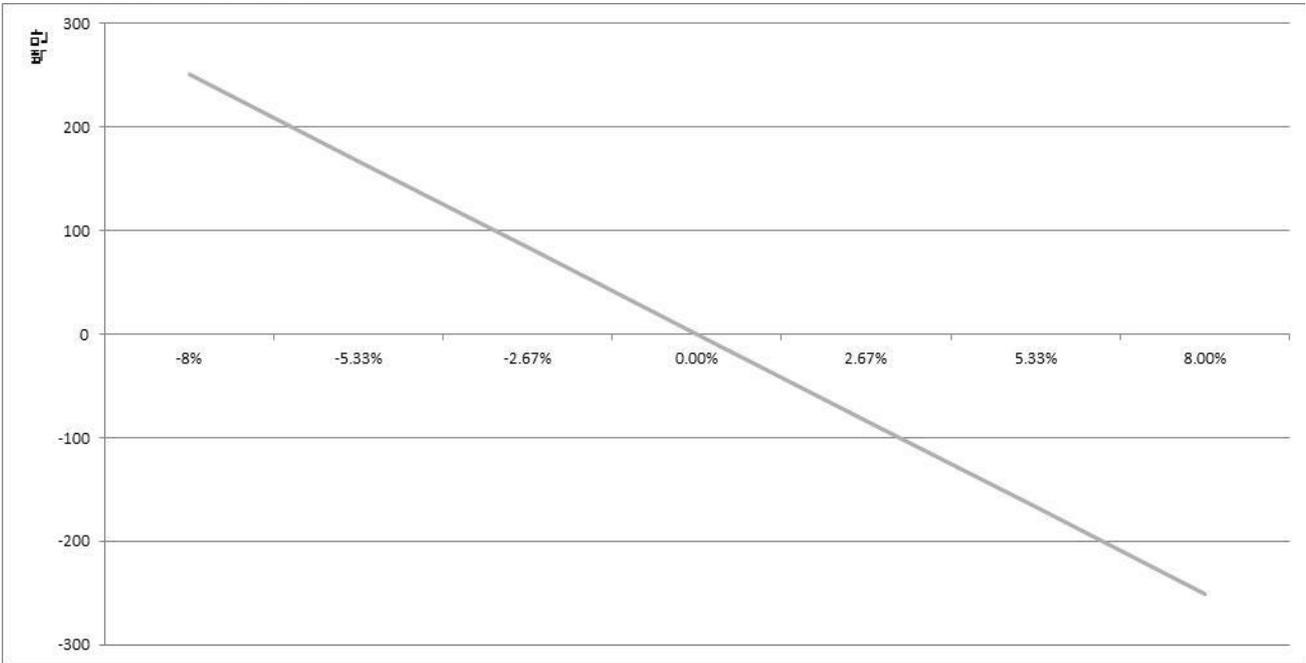
공시일: 2024-01-12

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	3,157	-3,157	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	4,472	0	4,472	장내
합계			4,472	3,157	1,315	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

251

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

257