

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

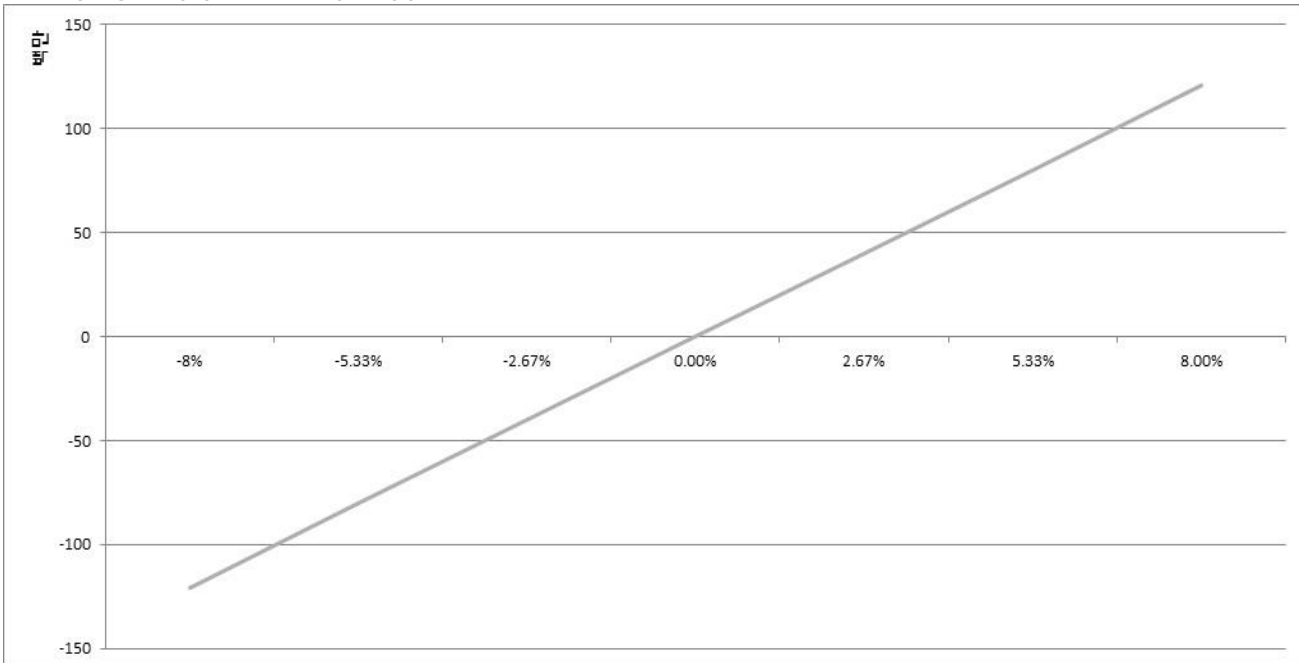
공시일: 2024-01-25

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	1,500	0	1,500	장내
신규	주식	주식	435	0	435	장내
누계	주식	주식	35,089	0	35,089	장내
신규	유가증권	선물	0	434	-434	장내
누계	유가증권	선물	527	0	527	장내
합계			37,116	0	37,116	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

121

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,487

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

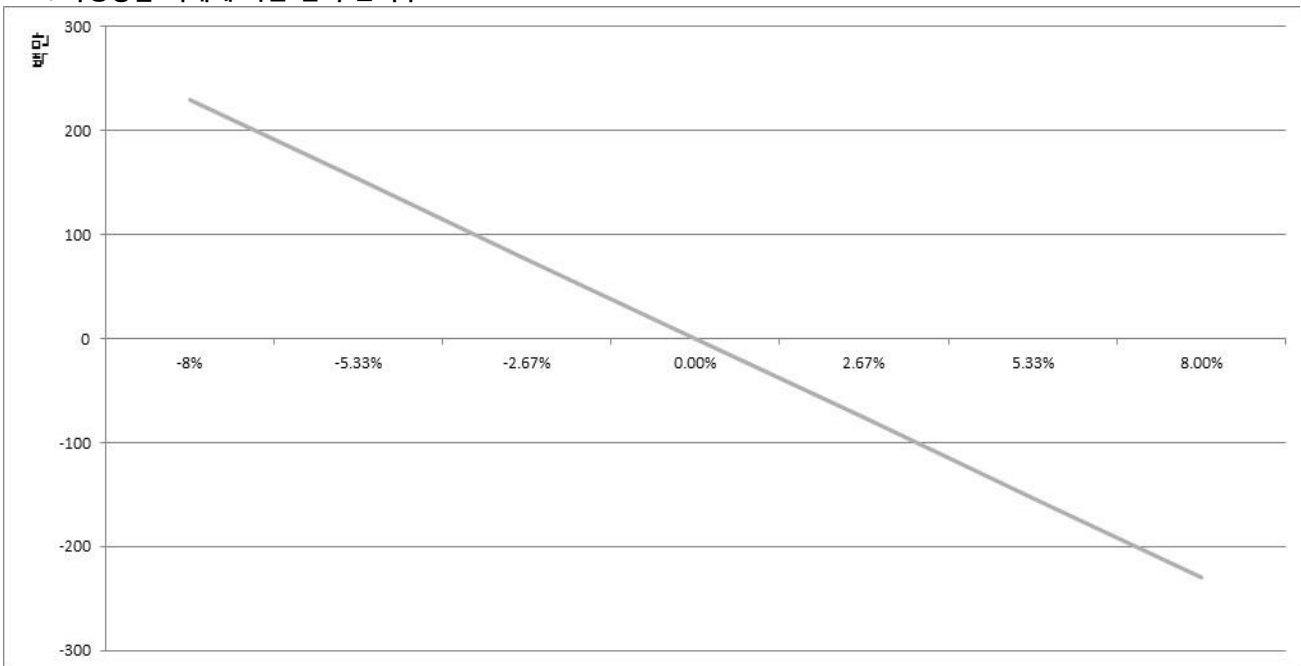
공시일: 2024-01-25

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	2,895	-2,895	장내
신규	주식	주식	69	84	-15	장내
누계	주식	주식	4,102	0	4,102	장내
합계			4,102	2,895	1,207	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

230

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

226