

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

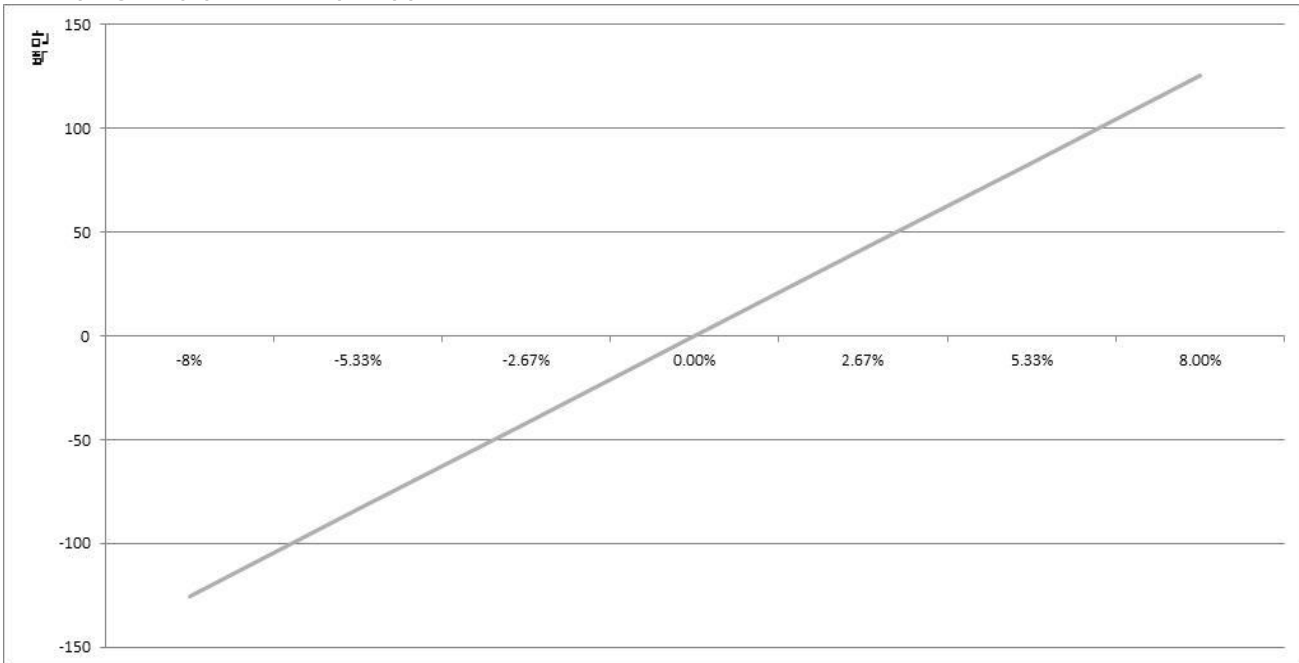
공시일: 2024-02-07

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	1,565	0	1,565	장내
신규	주식	주식	0	89	-89	장내
누계	주식	주식	36,049	0	36,049	장내
신규	유가증권	선물	89	0	89	장내
누계	유가증권	선물	1,114	0	1,114	장내
합계			38,728	0	38,728	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

125

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,579

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

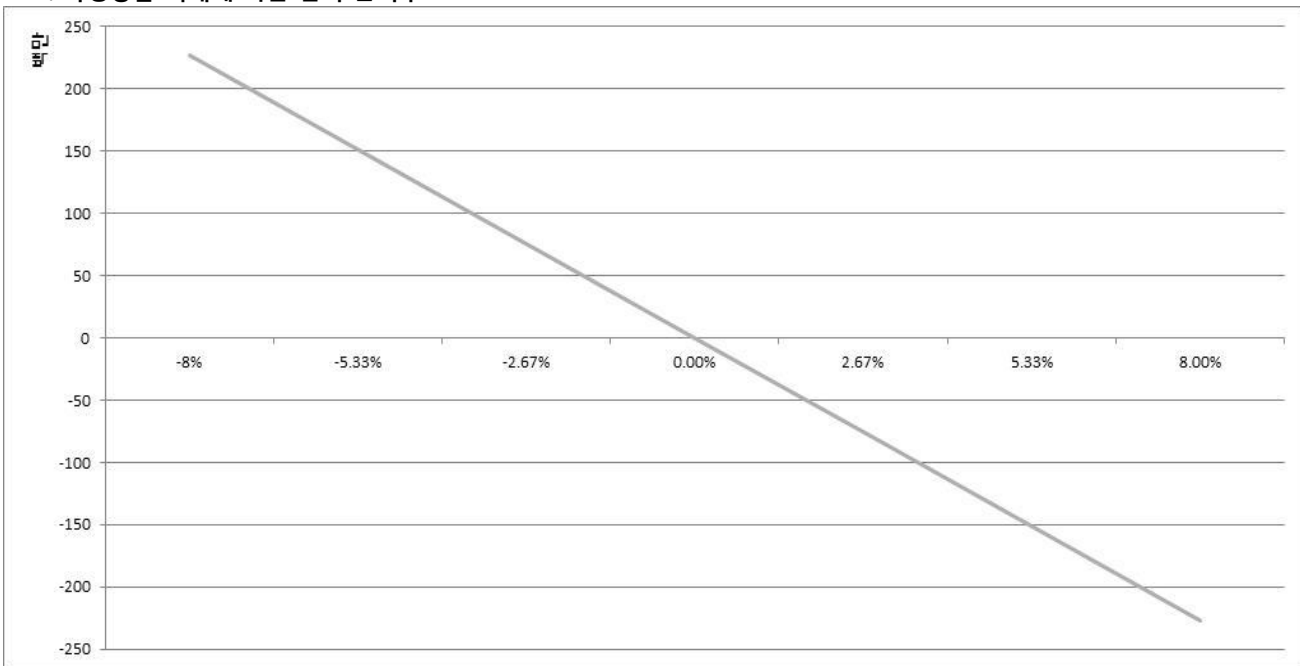
공시일: 2024-02-07

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	2,847	-2,847	장내
신규	주식	주식	5	5	0	장내
누계	주식	주식	4,331	0	4,331	장내
합계			4,331	2,847	1,484	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

227

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

243