

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

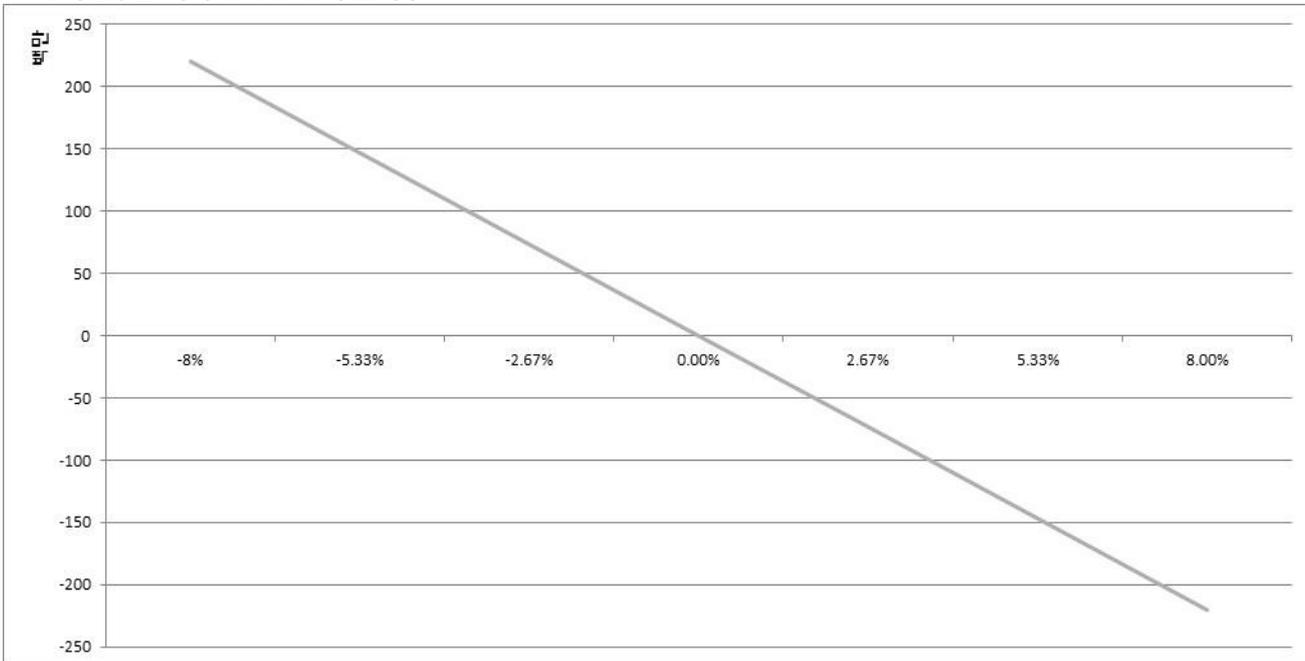
공시일: 2024-05-02

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	2,738	3,012	-274	장내
누계	주가지수	선물	0	2,738	-2,738	장내
신규	주식	주식	2	2,696	-2,694	장내
누계	주식	주식	30,377	0	30,377	장내
신규	유가증권	선물	56	83	-27	장내
누계	유가증권	선물	1,317	0	1,317	장내
합계			31,694	2,738	28,955	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

220

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,121

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

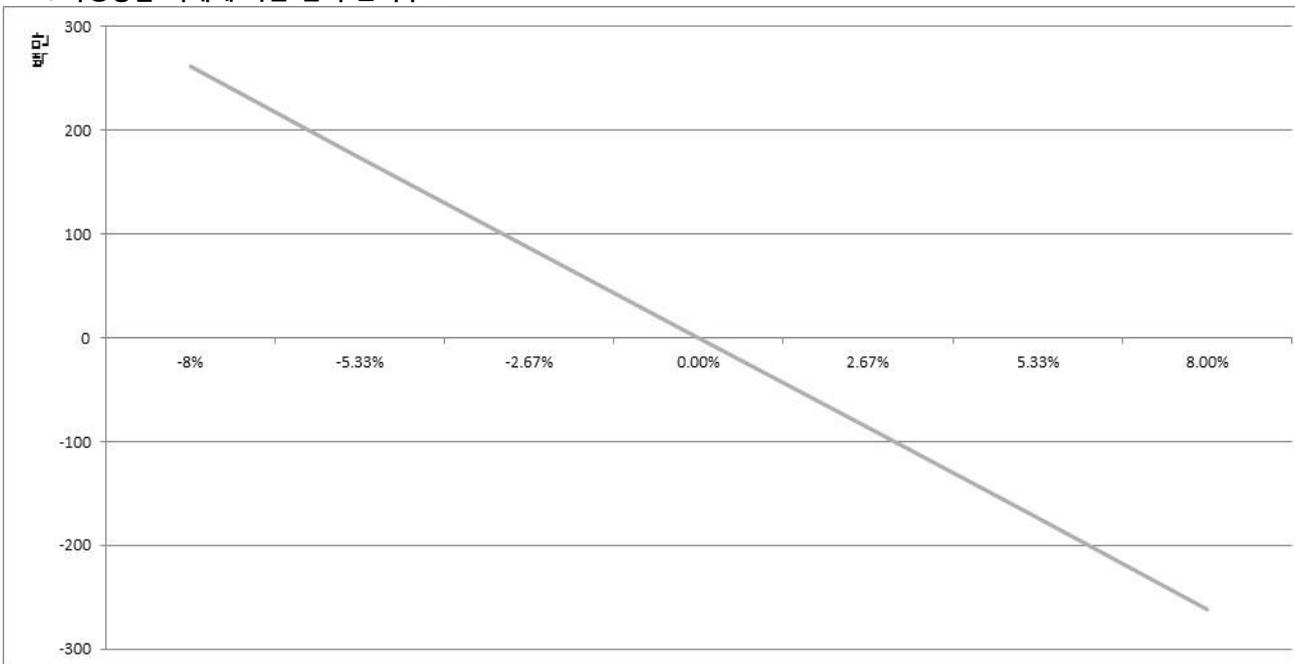
공시일: 2024-05-02

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	3,259	-3,259	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	4,662	0	4,662	장내
합계			4,662	3,259	1,402	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

261

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

397