

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

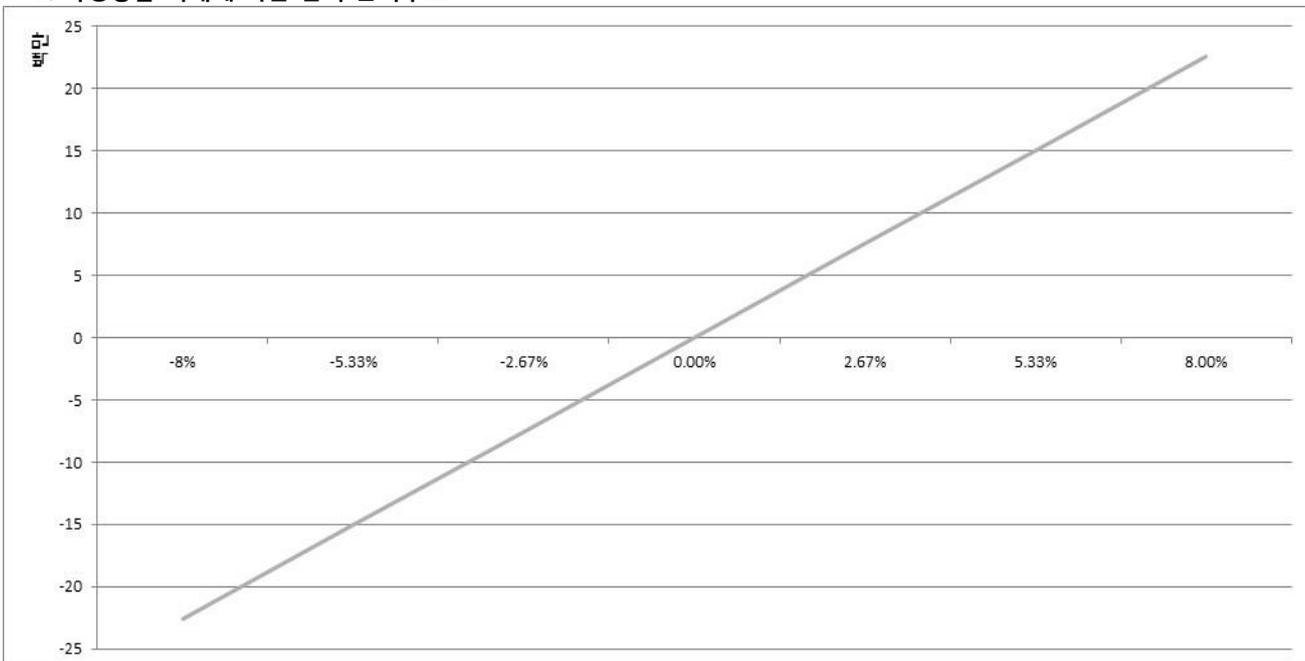
공시일: 2024-07-05

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	194	194	0	장내
신규	주식	주식	6	20	-14	장내
누계	주식	주식	28,811	0	28,811	장내
신규	유가증권	선물	20	0	20	장내
누계	유가증권	선물	477	0	477	장내
합계			29,482	194	29,288	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

23

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,186

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

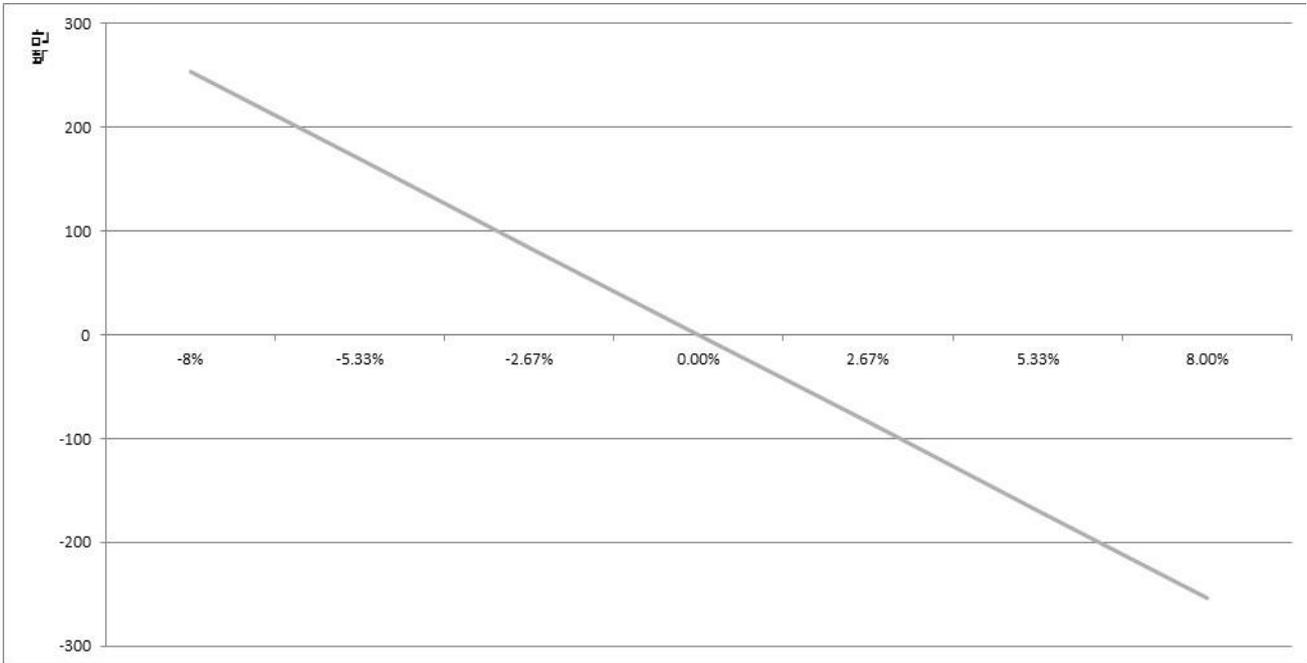
공시일: 2024-07-05

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	3,158	-3,158	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	4,223	0	4,223	장내
합계			4,223	3,158	1,065	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

254

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

335