

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

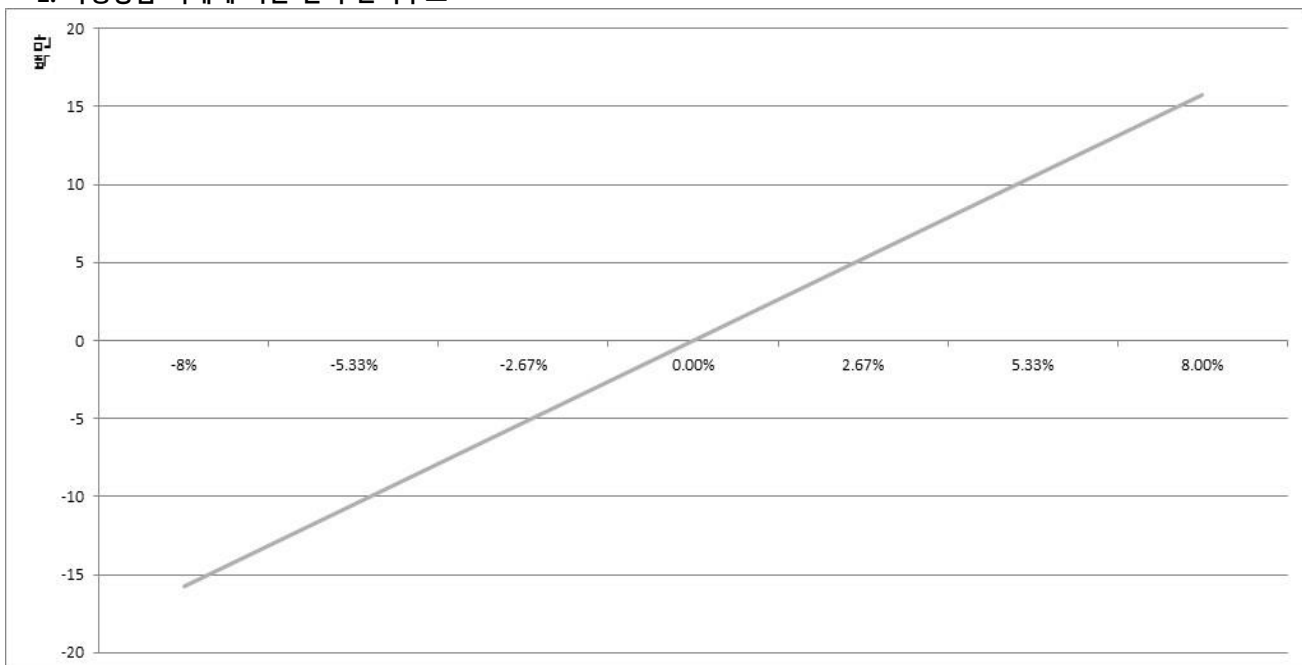
공시일: 2024-07-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주식	주식	3	249	-246	장내
누계	주식	주식	29,176	0	29,176	장내
신규	유가증권	선물	232	0	232	장내
누계	유가증권	선물	355	0	355	장내
합계			29,531	0	29,531	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

16

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,344

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

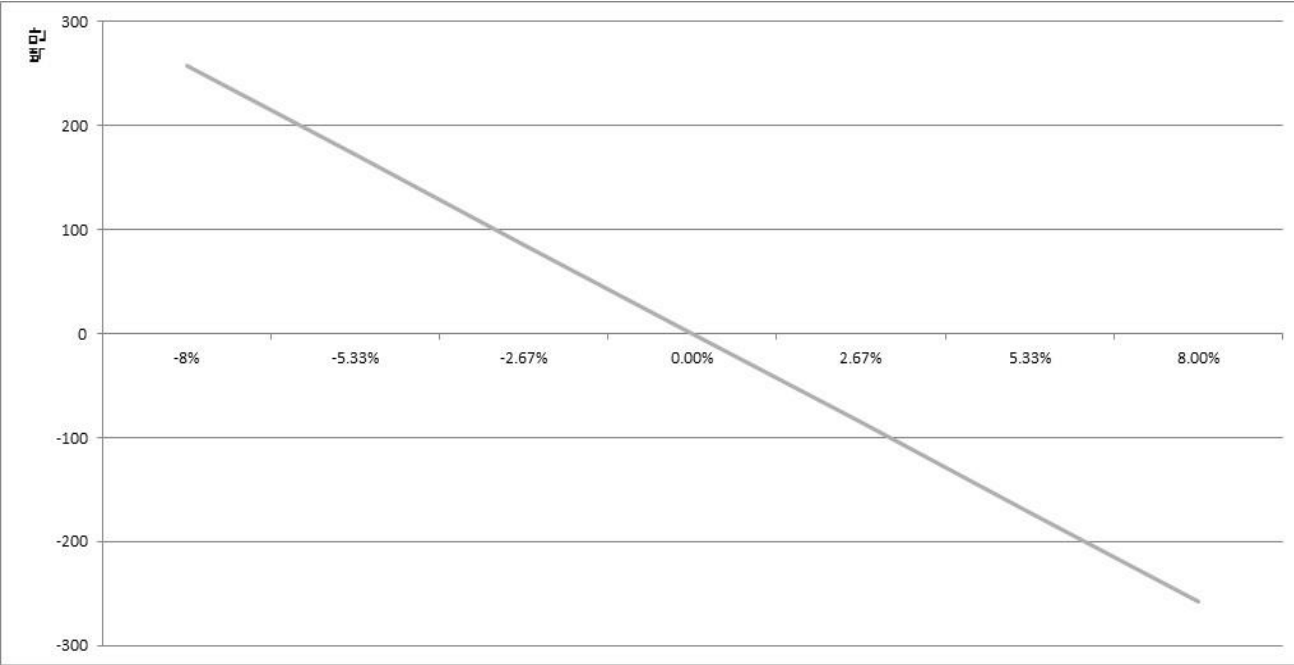
공시일: 2024-07-15

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	3,211	-3,211	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	4,296	0	4,296	장내
합계			4,296	3,211	1,084	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

258

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

351