

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

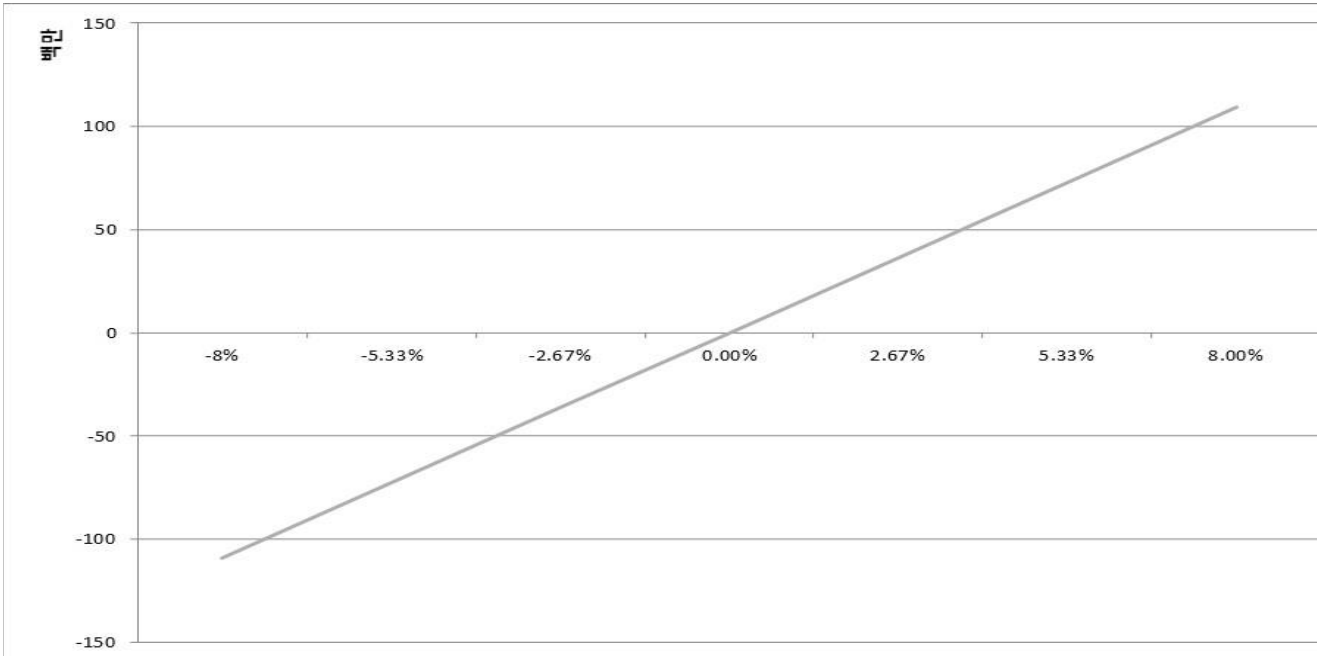
공시일: 2023-06-27

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	1,362	0	1,362	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	32,651	0	32,651	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	94	260	-166	장내
합계			34,107	260	33,846	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,557

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

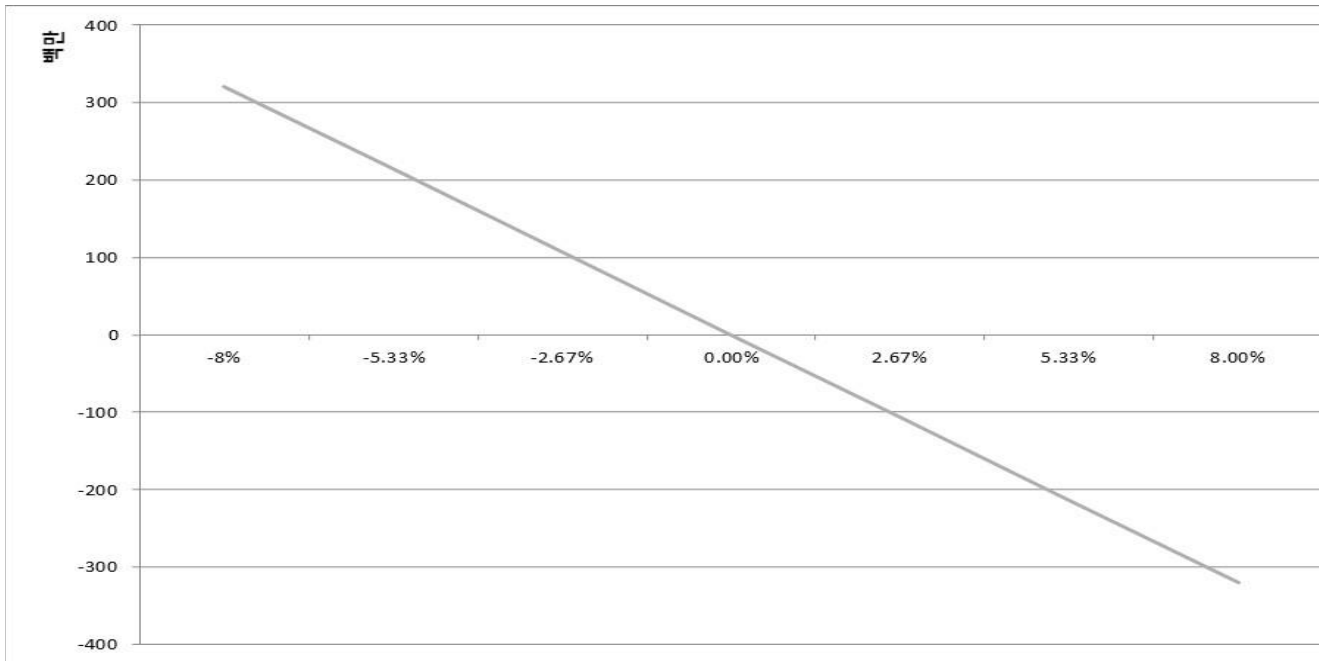
공시일: 2023-06-27

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	4,038	-4,038	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	6,218	0	6,218	장내
합계			6,218	4,038	2,181	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

321

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

441