

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

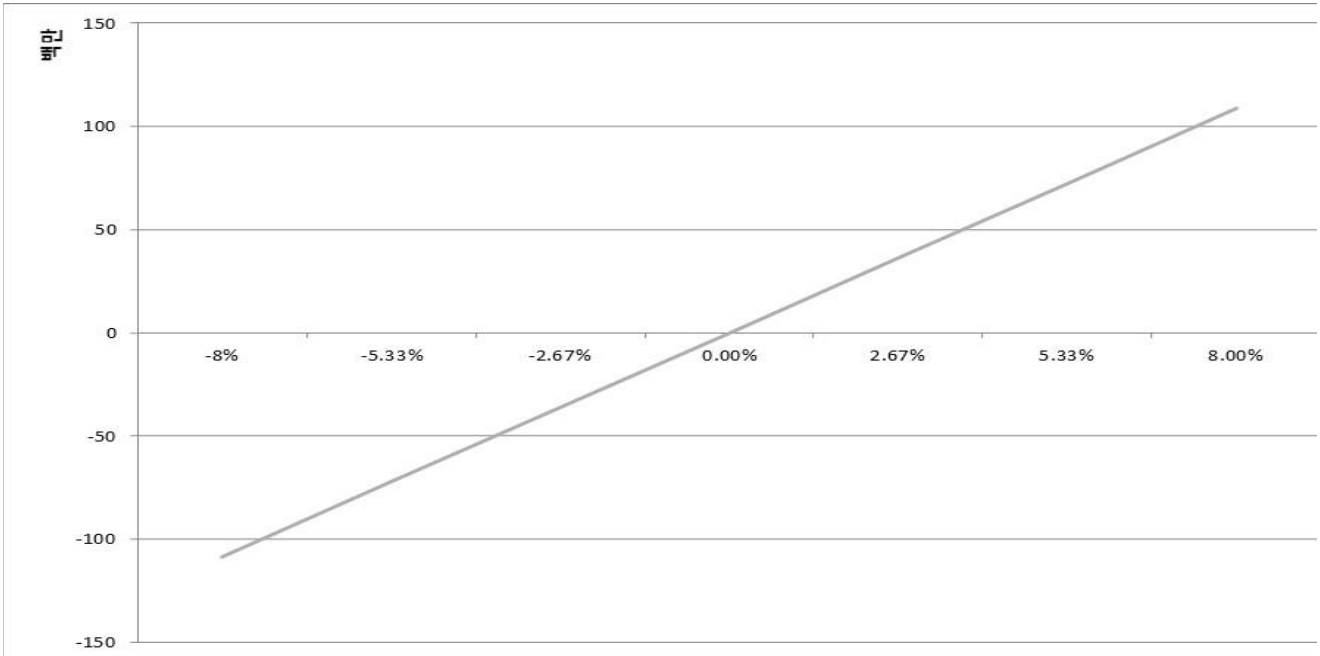
공시일: 2023-06-29

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	1,353	0	1,353	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	32,467	0	32,467	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	92	260	-168	장내
합계			33,912	260	33,652	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,505

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

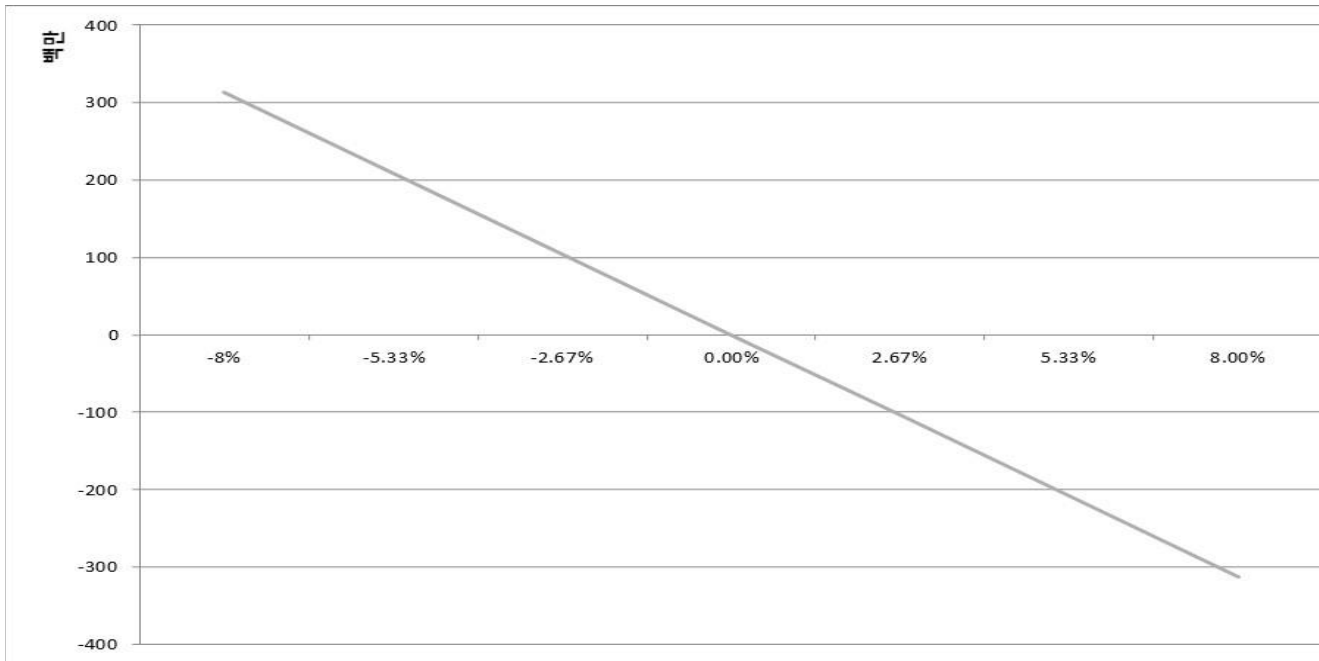
공시일: 2023-06-29

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	3,847	-3,847	장내
신규	주식	주식	56	0	56	장내
누계	주식	주식	6,180	0	6,180	장내
합계			6,180	3,847	2,333	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

313

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

436