

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

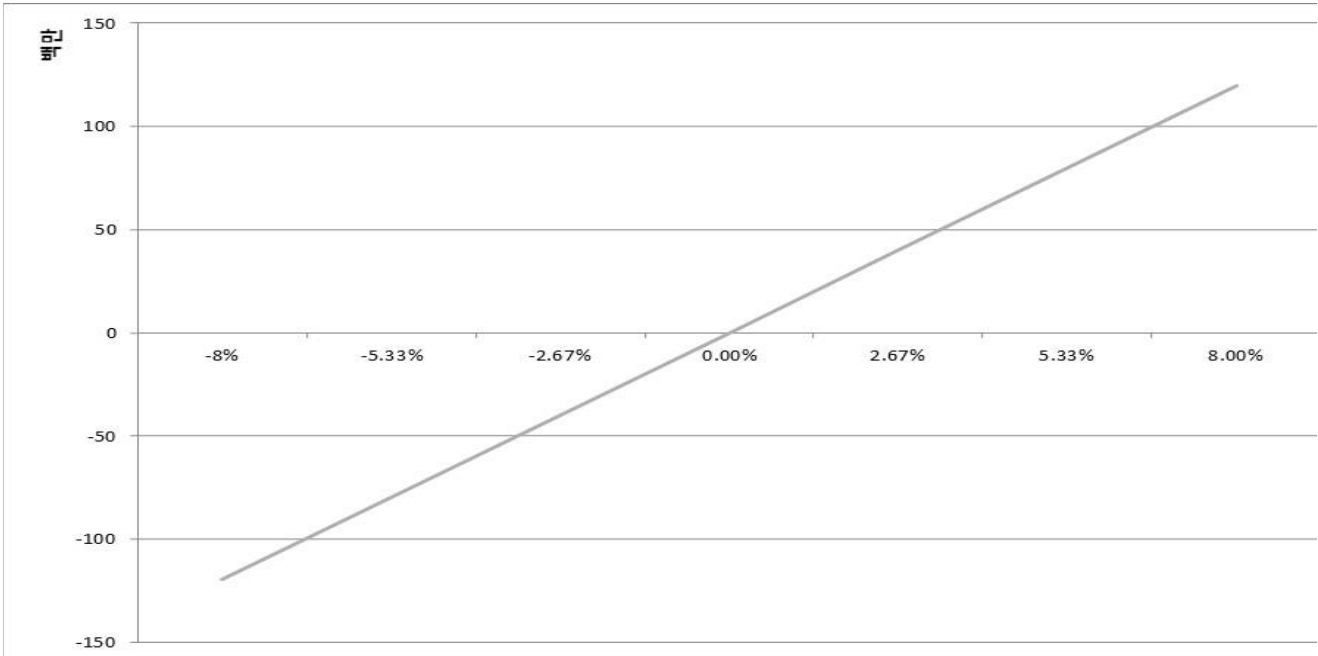
공시일: 2023-07-11

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	1,489	0	1,489	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	31,721	0	31,721	장내
신규	유가증권	선물	5	5	0	장내
누계	유가증권	선물	105	269	-164	장내
합계			33,315	269	33,046	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

120

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,387

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

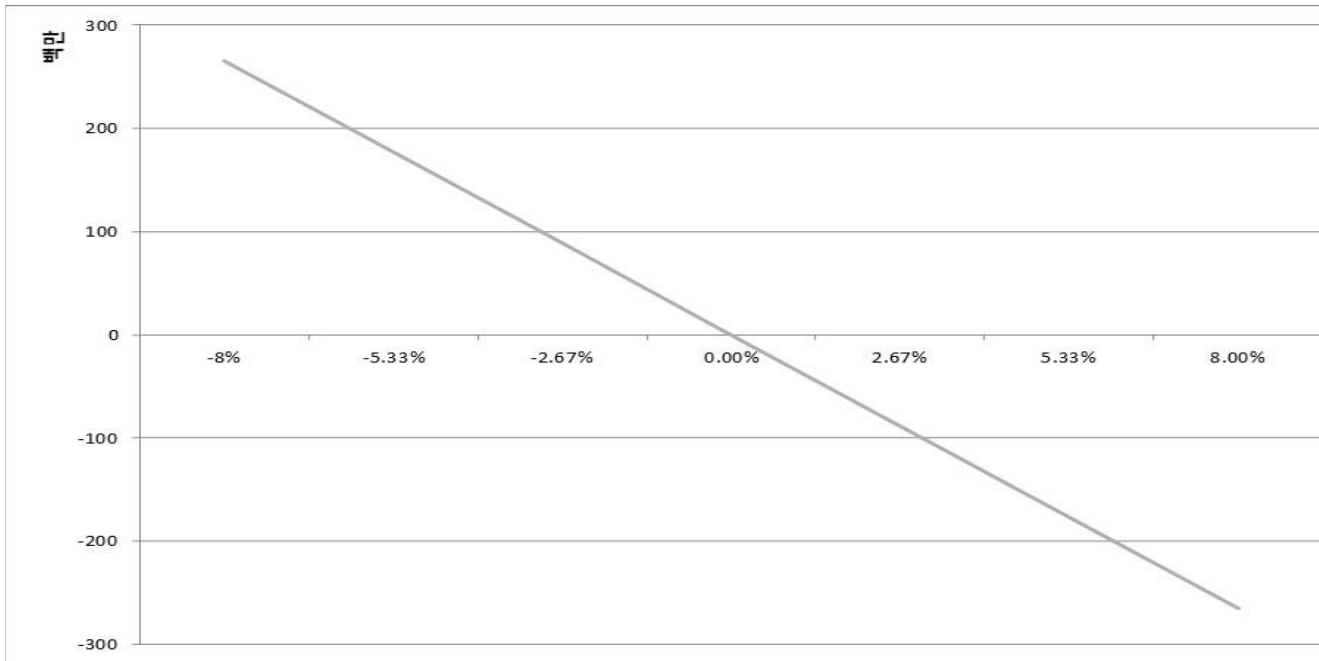
공시일: 2023-07-11

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	3,335	-3,335	장내
신규	주식	주식	0	112	-112	장내
누계	주식	주식	5,939	0	5,939	장내
합계			5,939	3,335	2,603	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

265

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

414