

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

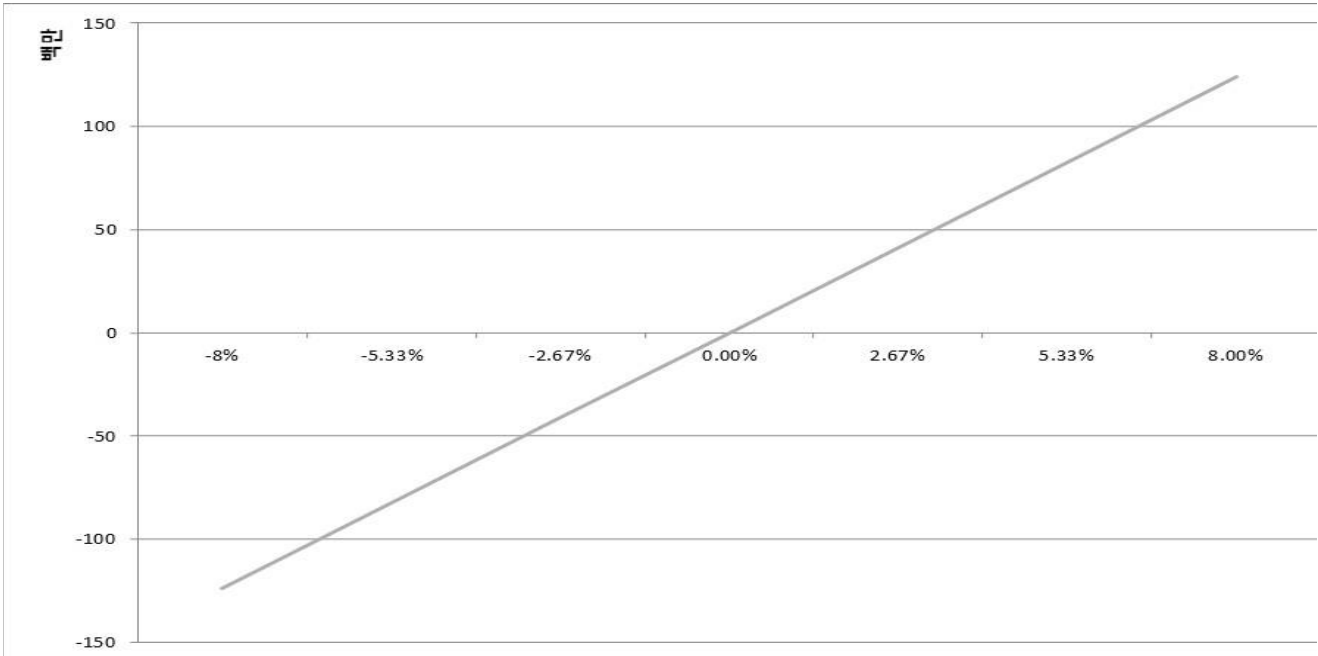
공시일: 2023-07-14

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	1,535	0	1,535	장내
신규	주식	주식	31	263	-232	장내
누계	주식	주식	32,475	0	32,475	장내
신규	유가증권	선물	357	115	241	장내
누계	유가증권	선물	100	16	84	장내
합계			34,110	16	34,094	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

124

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,478

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

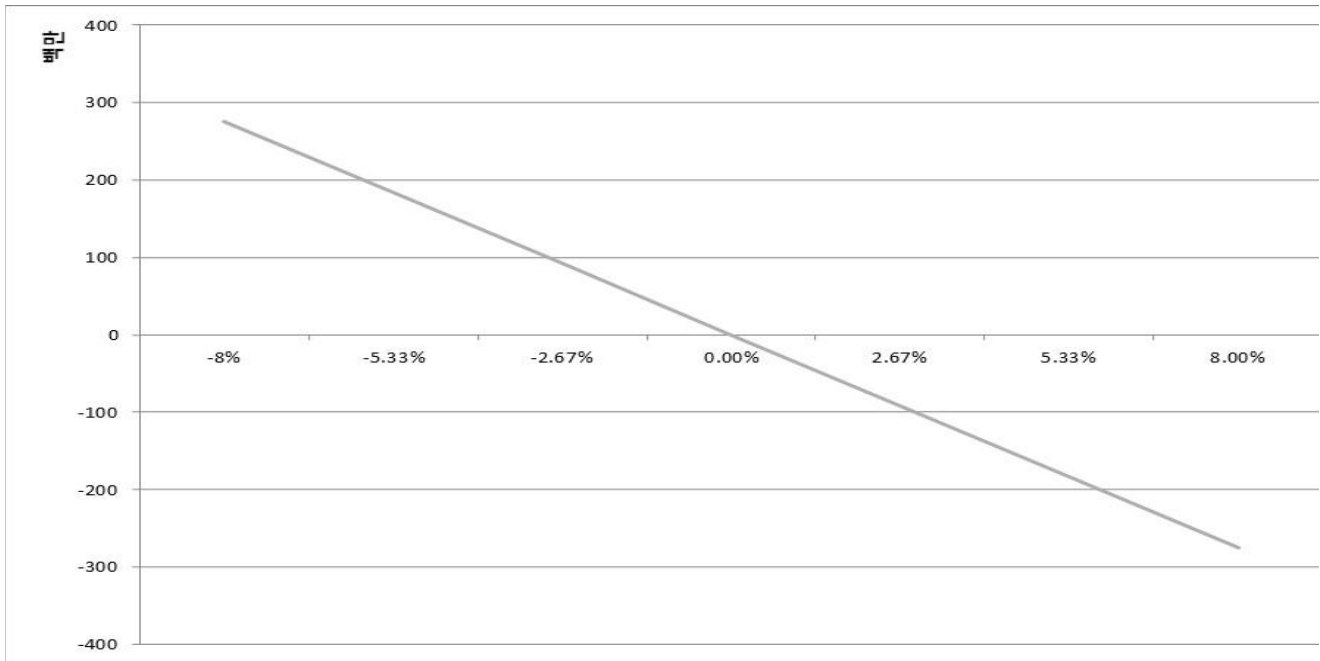
공시일: 2023-07-14

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	3,456	-3,456	장내
신규	주식	주식	28	0	28	장내
누계	주식	주식	6,244	0	6,244	장내
합계			6,244	3,456	2,788	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

275

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

408