

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

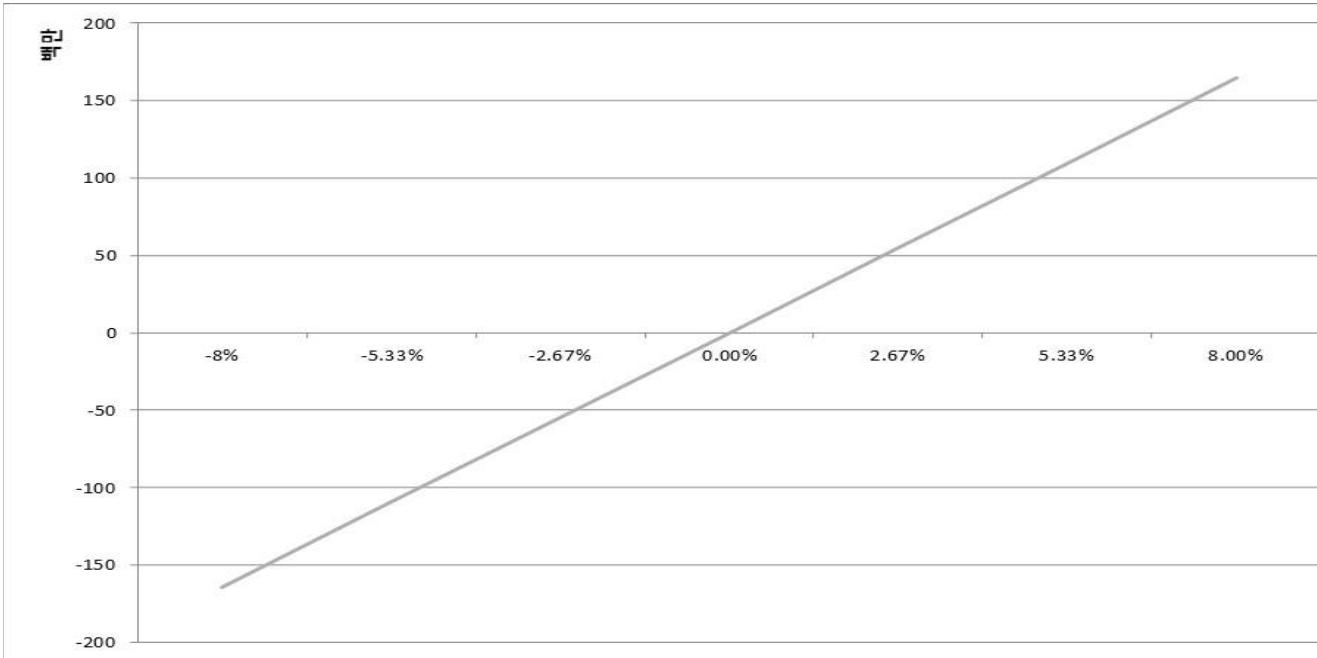
공시일: 2023-07-27

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	2,043	0	2,043	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	32,172	0	32,172	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	335	16	319	장내
합계			34,549	16	34,534	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

164

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,523

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

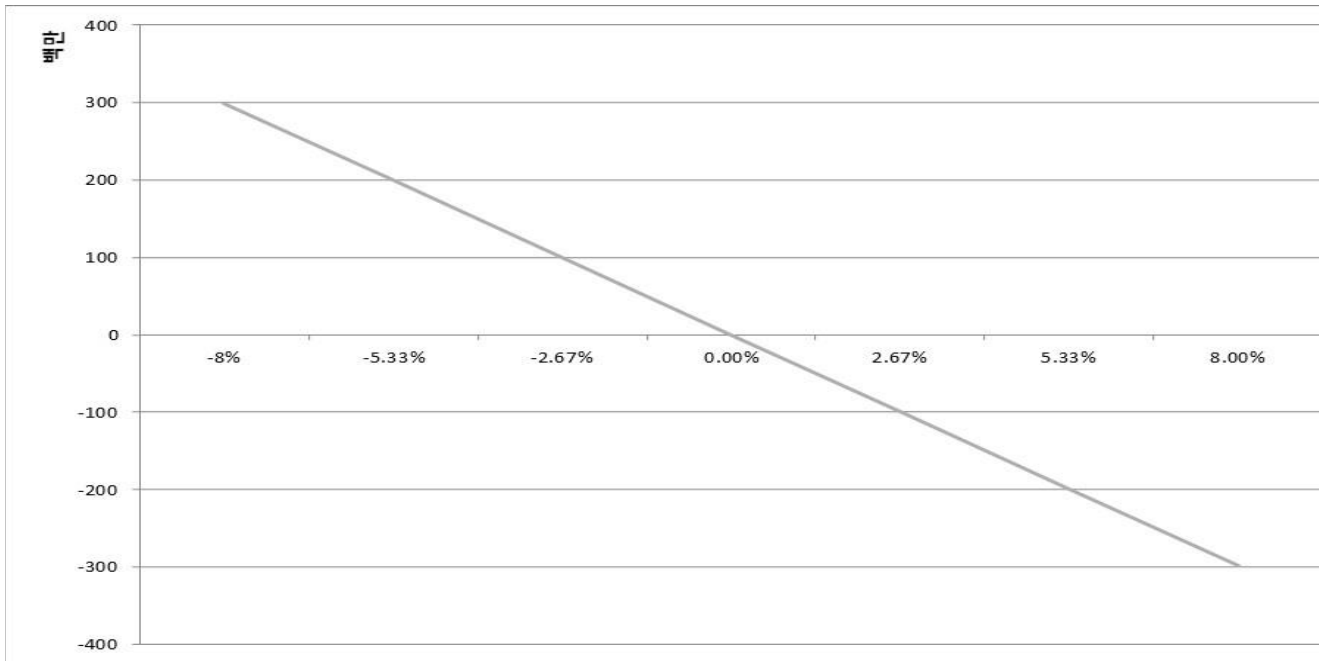
공시일: 2023-07-27

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	3,790	-3,790	장내
신규	주식	주식	22	679	-657	장내
누계	주식	주식	5,166	0	5,166	장내
합계			5,166	3,790	1,376	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

299

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

303