

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

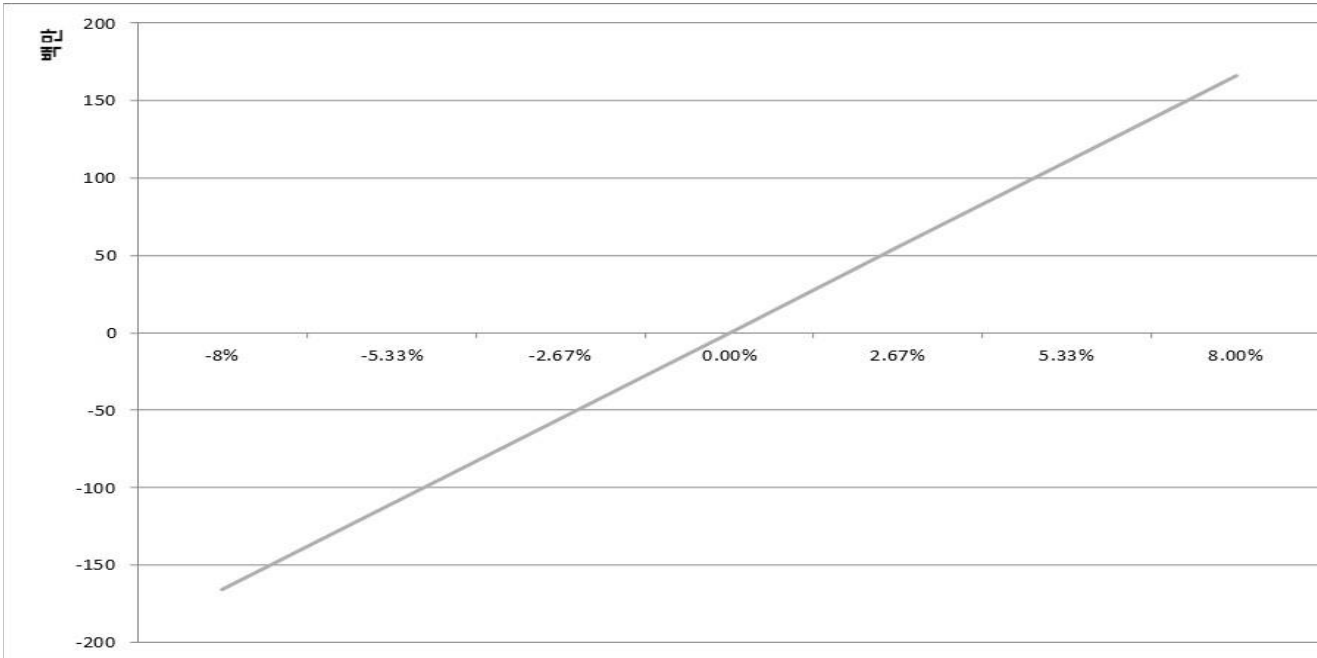
공시일: 2023-07-28

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	2,069	0	2,069	장내
신규	주식	주식	0	137	-137	장내
누계	주식	주식	32,449	0	32,449	장내
신규	유가증권	선물	137	0	137	장내
누계	유가증권	선물	469	16	453	장내
합계			34,986	16	34,971	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

166

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,562

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

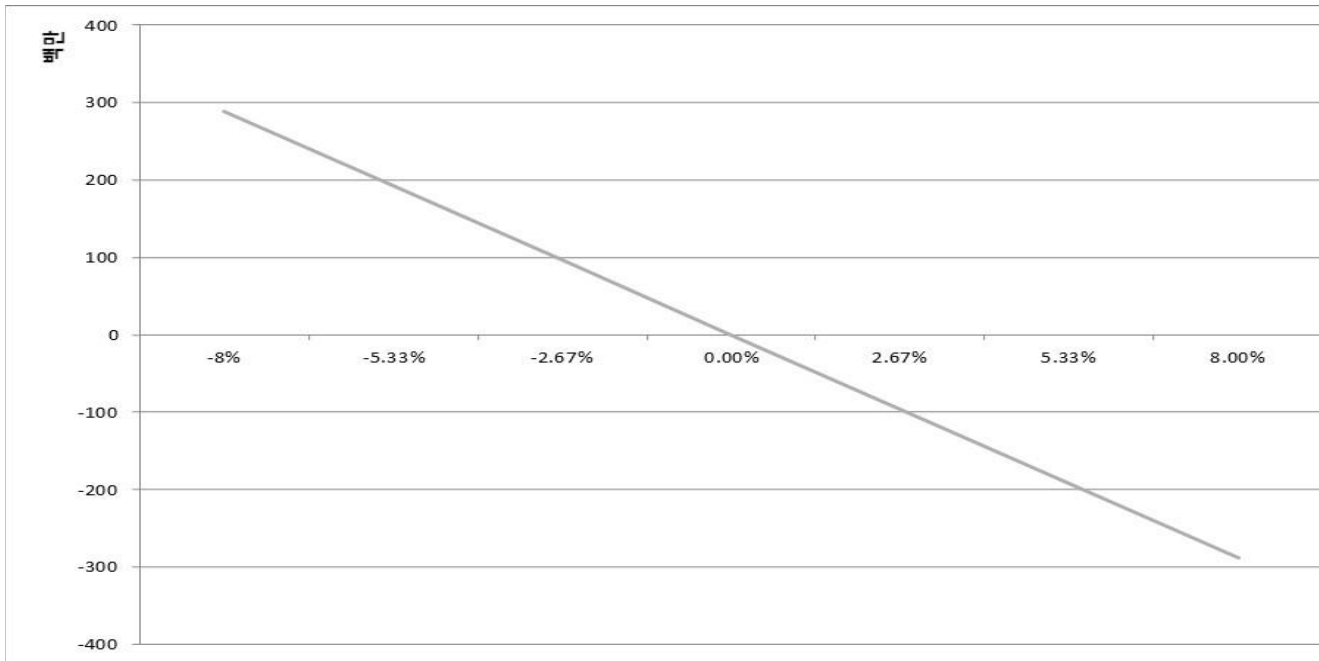
공시일: 2023-07-28

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	3,623	-3,623	장내
신규	주식	주식	9	13	-5	장내
누계	주식	주식	5,195	0	5,195	장내
합계			5,195	3,623	1,572	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

288

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

334