

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

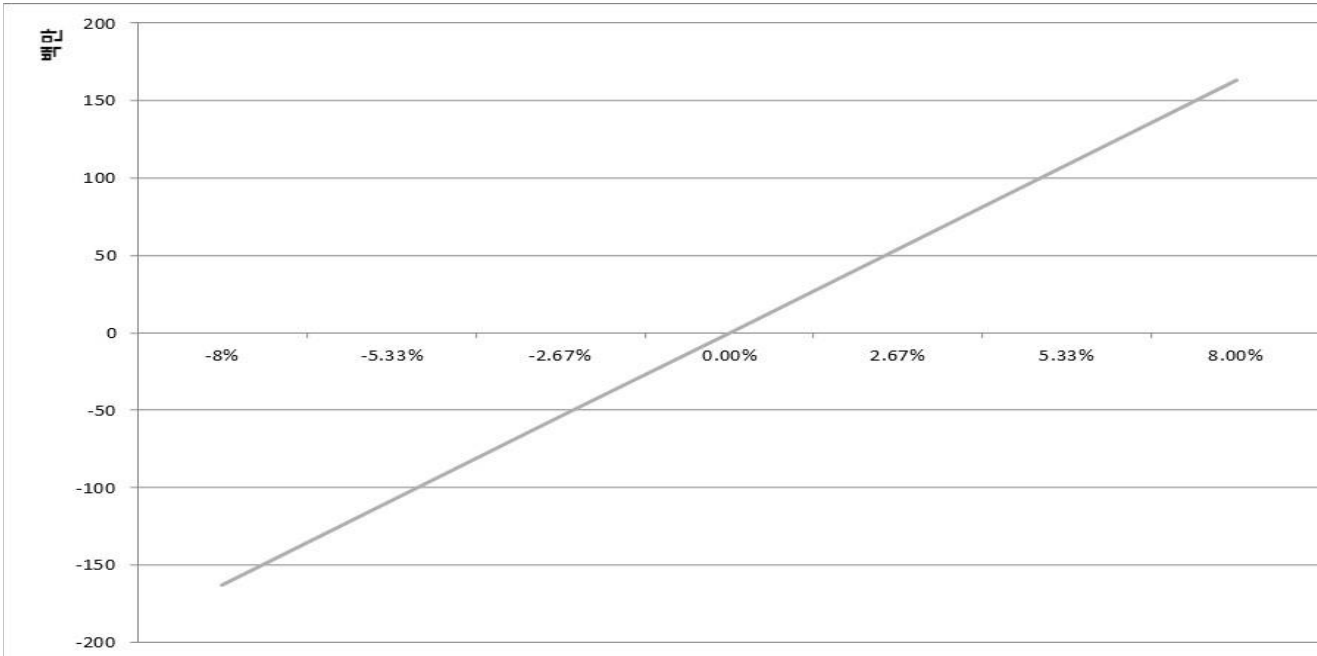
공시일: 2023-08-09

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	2,028	0	2,028	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	31,817	0	31,817	장내
신규	유가증권	선물	16	16	0	장내
누계	유가증권	선물	461	16	446	장내
합계			34,306	16	34,290	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

163

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,523

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

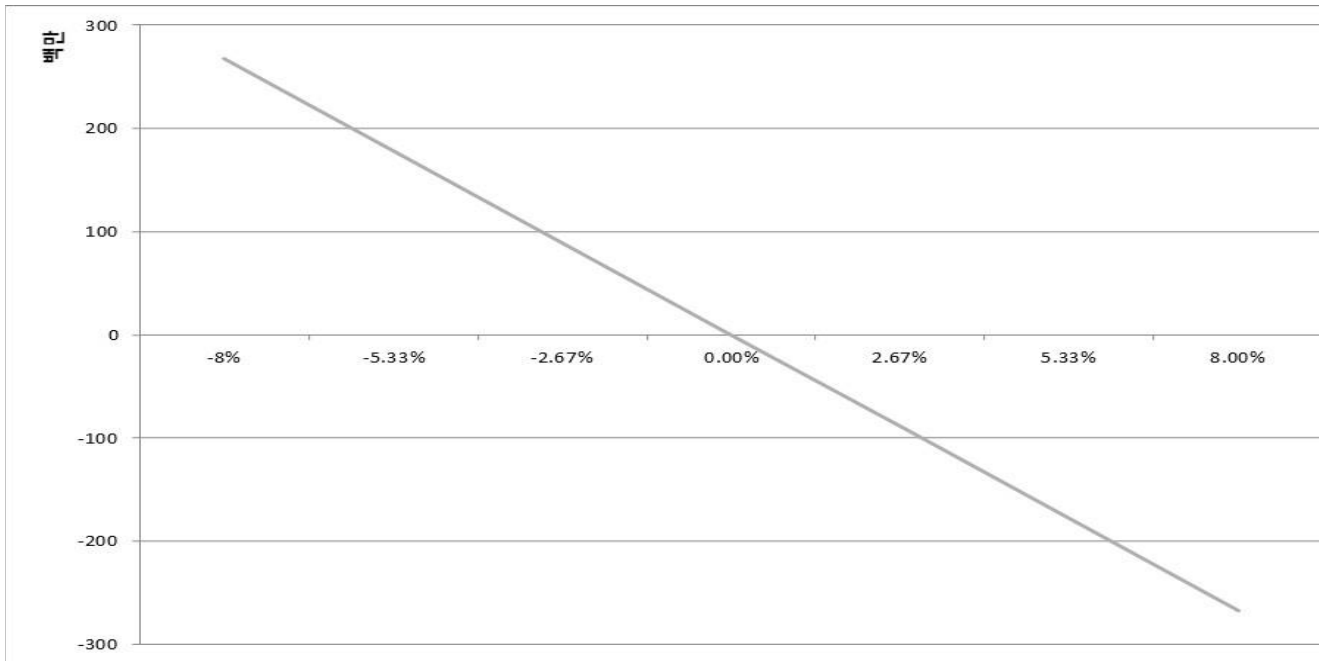
공시일: 2023-08-09

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	3,374	-3,374	장내
신규	주식	주식	339	40	300	장내
누계	주식	주식	5,597	0	5,597	장내
합계			5,597	3,374	2,223	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

268

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

331