

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

공시일: 2022-08-02

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	4,441	0	4,441	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	26,295	0	26,295	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	171	0	171	장내
합계			30,907	0	30,907	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

356

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

2,534

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

공시일: 2022-08-02

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	5,510	-5,510	장내
신규	주식	주식	329	30	299	장내
누계	주식	주식	9,666	0	9,666	장내
합계			9,666	5,510	4,156	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조

3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

440

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

705