

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

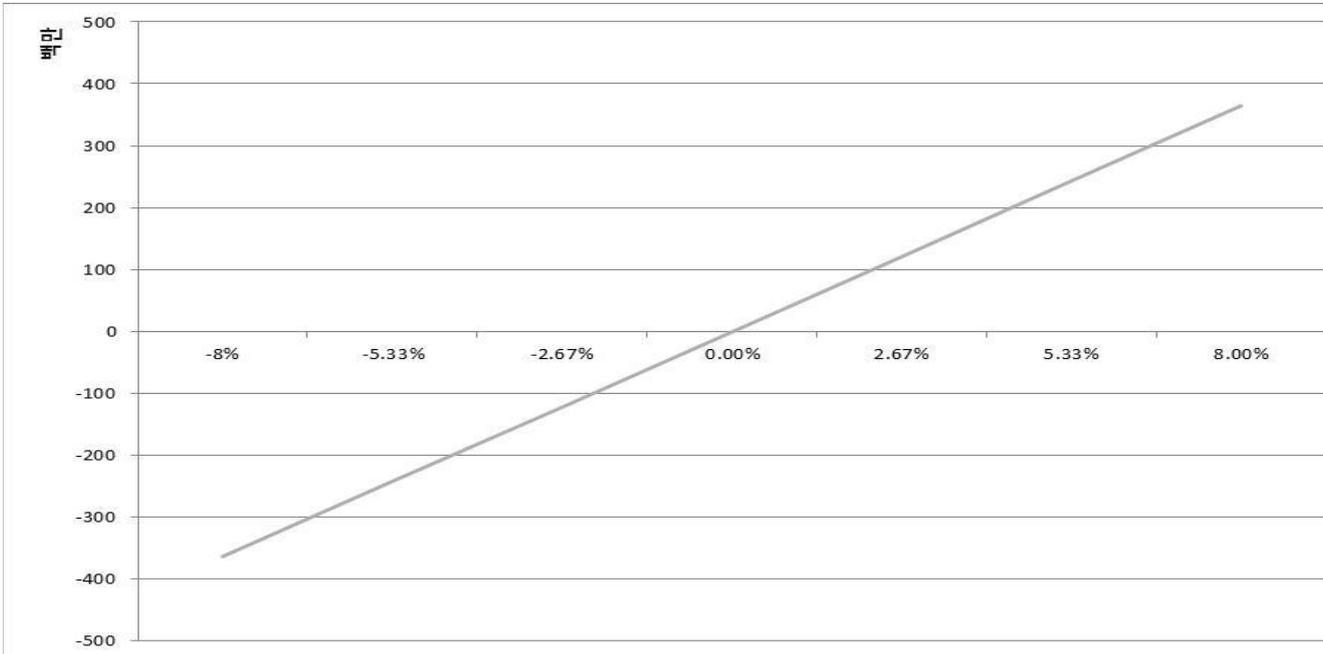
공시일: 2022-08-16

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 | 4,547 | 0 | 4,547 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 0 | 41 | -41 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 26,961 | 0 | 26,961 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 41 | 0 | 41 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 128 | 0 | 128 | 장내 |
| 합계 | | | 31,636 | 0 | 31,636 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

364

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,626

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

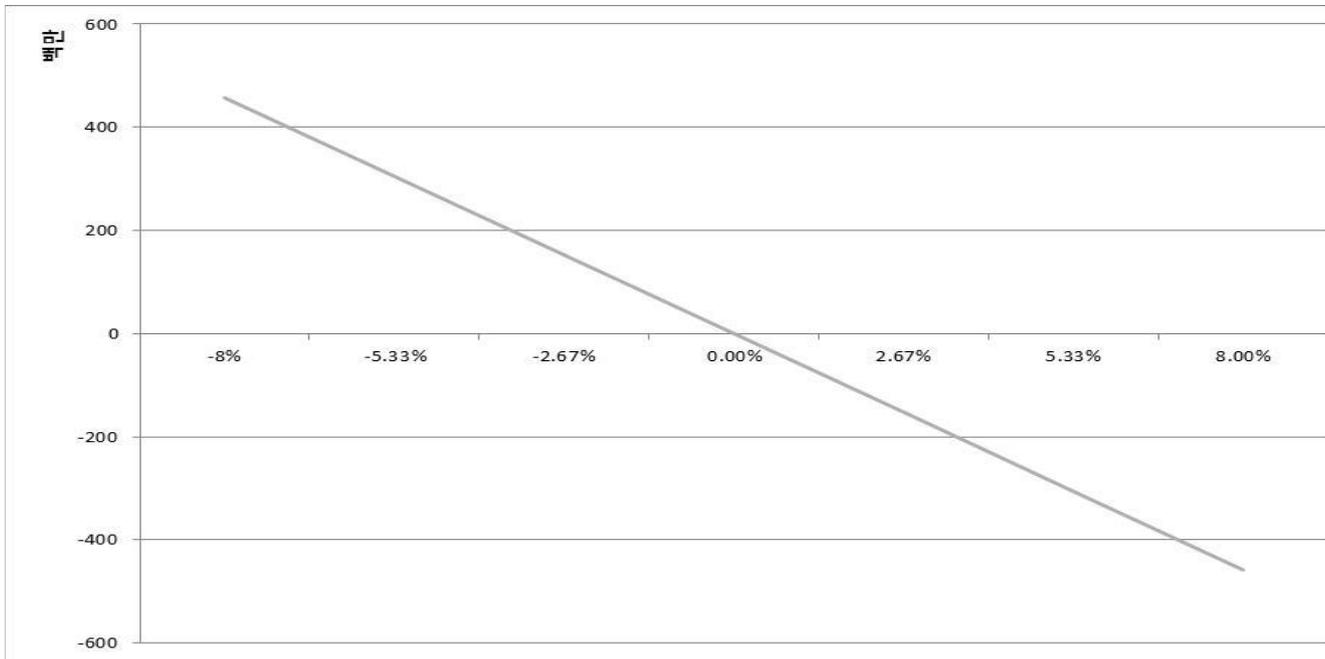
공시일: 2022-08-16

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 | 5,707 | -5,707 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 27 | 99 | -72 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 10,044 | 0 | 10,044 | 장내 |
| 합계 | | | 10,044 | 5,707 | 4,338 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

457

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

595