

펀드명 : 트러스트인덱스알파[주식-파생형](모)

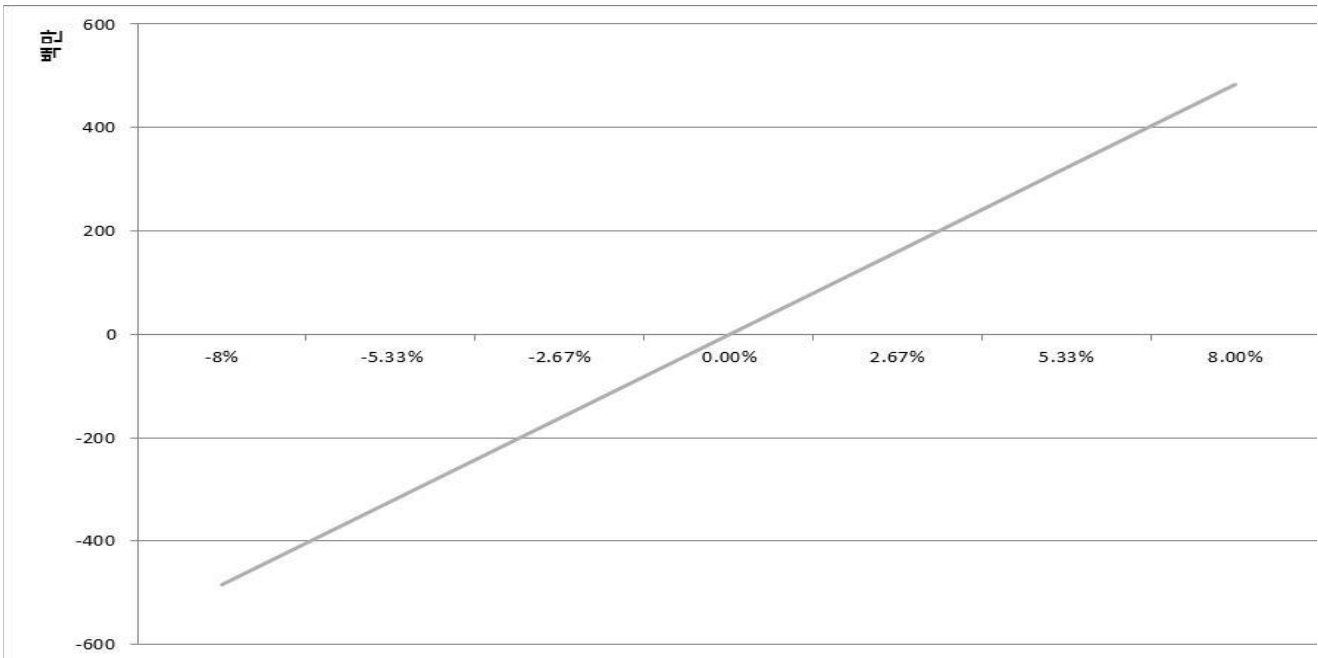
공시일: 2022-11-15

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 | 6,029 | 0 | 6,029 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 5 | 0 | 5 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 26,083 | 0 | 26,083 | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물 | 0 | 0 | 0 | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물 | 351 | 0 | 351 | 장내 |
| 합계 | | | 32,462 | 0 | 32,462 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

484

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

2,796

펀드명 : 트러스트코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

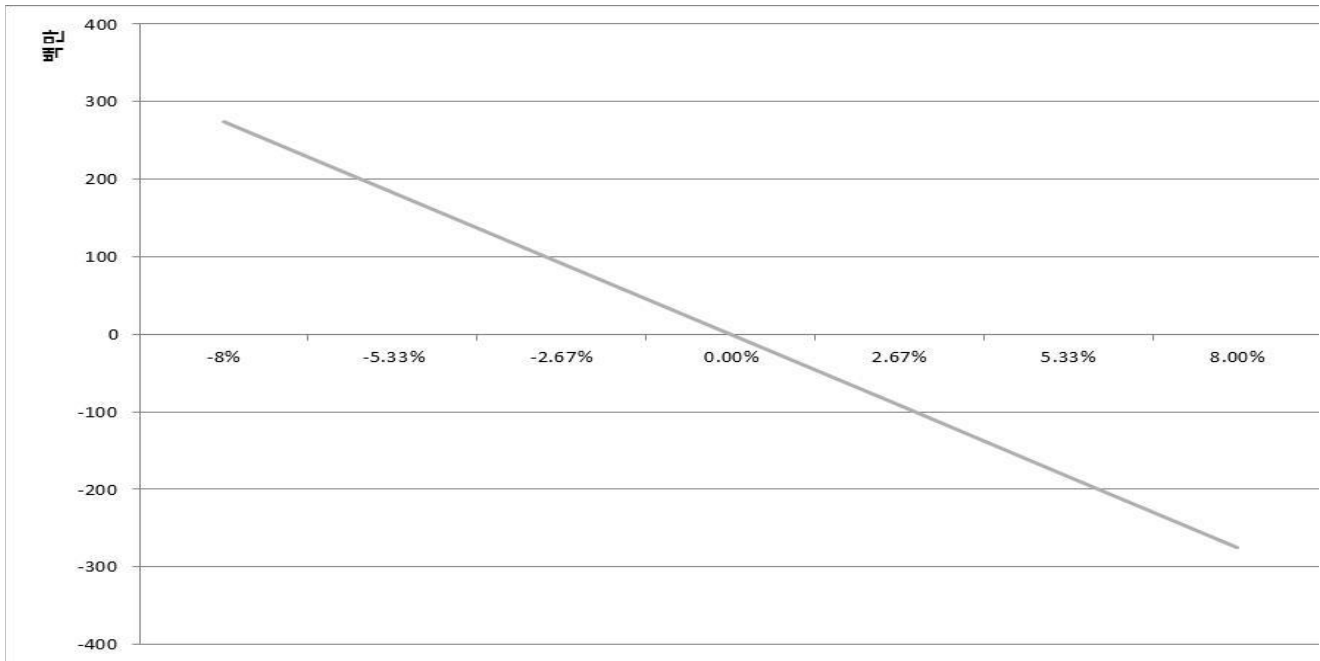
공시일: 2022-11-15

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 | 3,426 | -3,426 | 장내 |
| 신규 | 주식 | 주식 | 119 | 67 | 51 | 장내 |
| 누계 | 주식 | 주식 | 9,645 | 0 | 9,645 | 장내 |
| 합계 | | | 9,645 | 3,426 | 6,220 | |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

275

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

939