펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

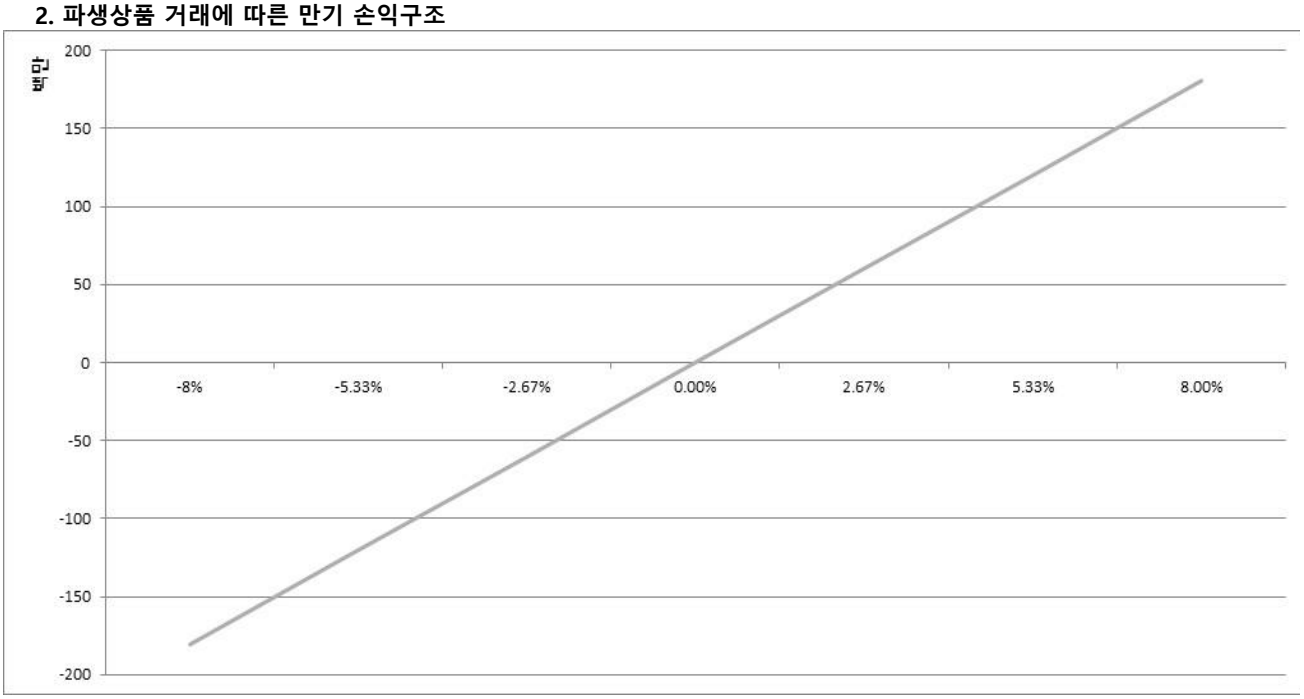
공시일: 2025-02-12

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	1,347	0	1,347	장내
신규	주식	주식	7	121	-114	장내
누계	주식	주식	42,617	0	42,617	장내
신규	유가증권	선물	554	445	109	장내
누계	유가증권	선물	3,137	0	3,137	장내
합계			47,100	0	47,100	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

181

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,511

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

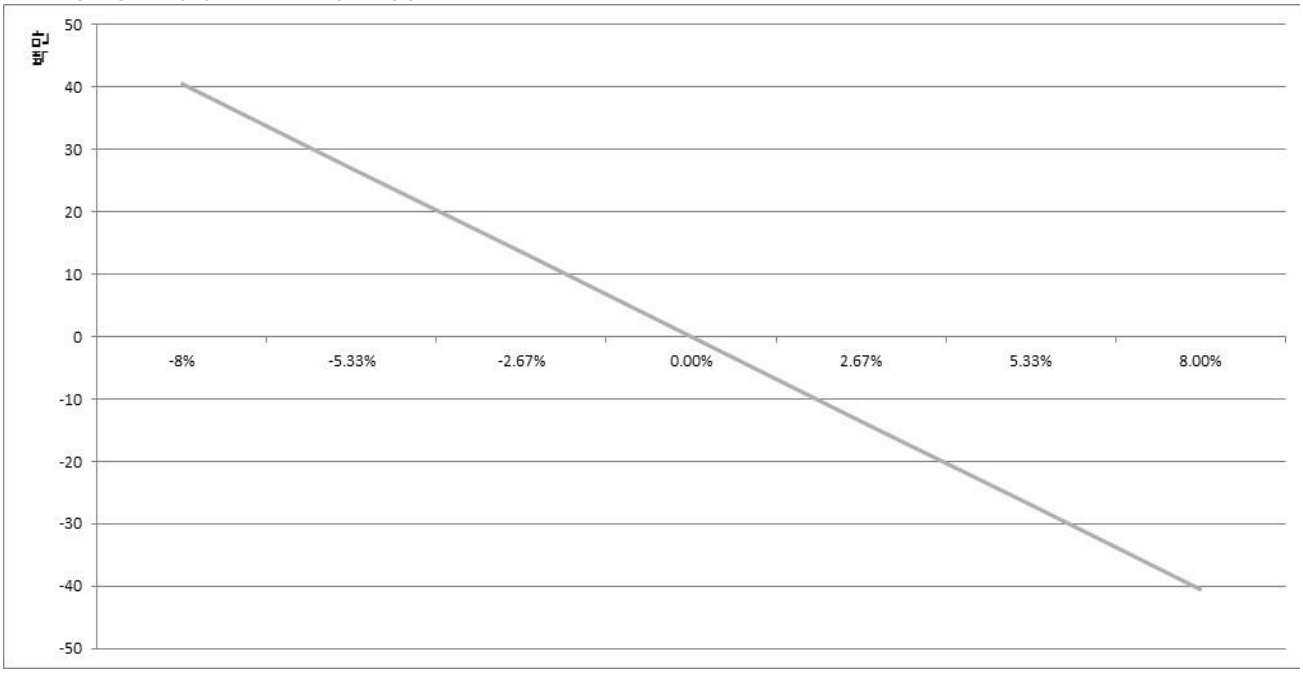
공시일: 2025-02-12

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	505	-505	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	3,318	0	3,318	장내
합계			3,318	505	2,814	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동	40

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)	459