펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

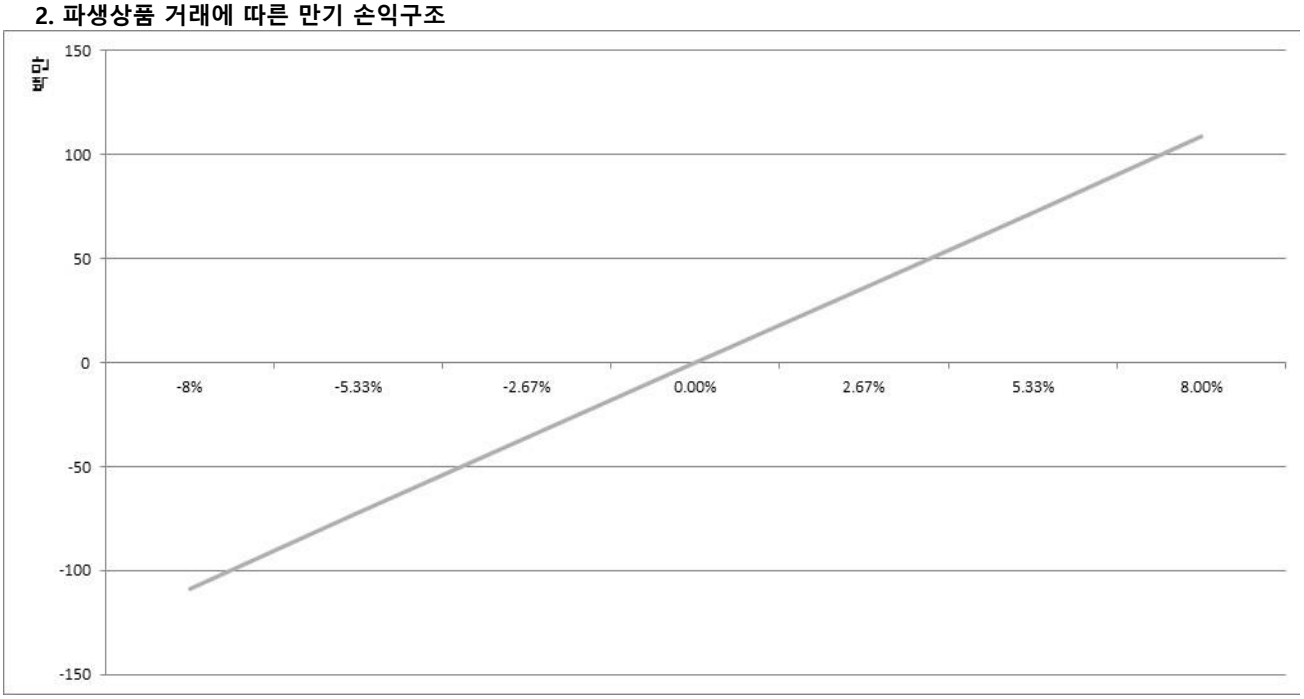
공시일: 2025-02-14

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	1,364	0	1,364	장내
신규	주식	주식	2,696	256	2,440	장내
누계	주식	주식	45,528	0	45,528	장내
신규	유가증권	선물	235	2,696	-2,461	장내
누계	유가증권	선물	811	0	811	장내
합계			47,703	0	47,703	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

109

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

4,565

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

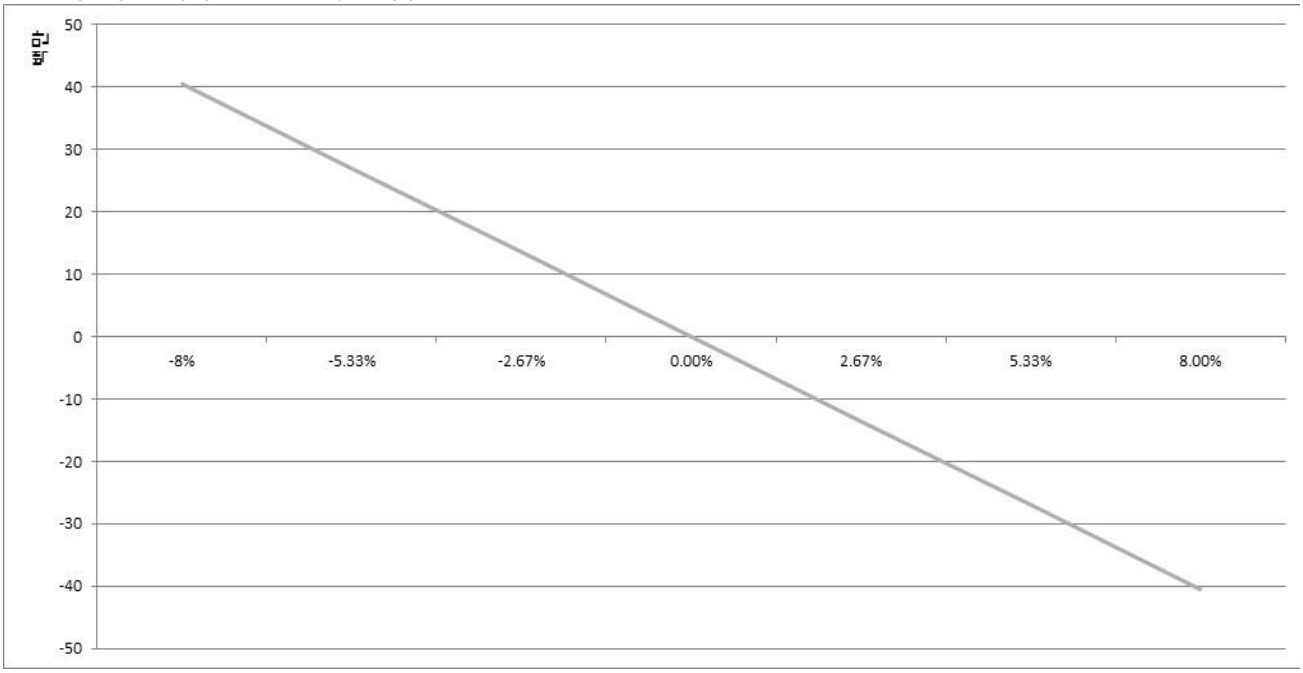
공시일: 2025-02-14

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	504	-504	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	3,316	0	3,316	장내
합계			3,316	504	2,811	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

41

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

458