

## 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

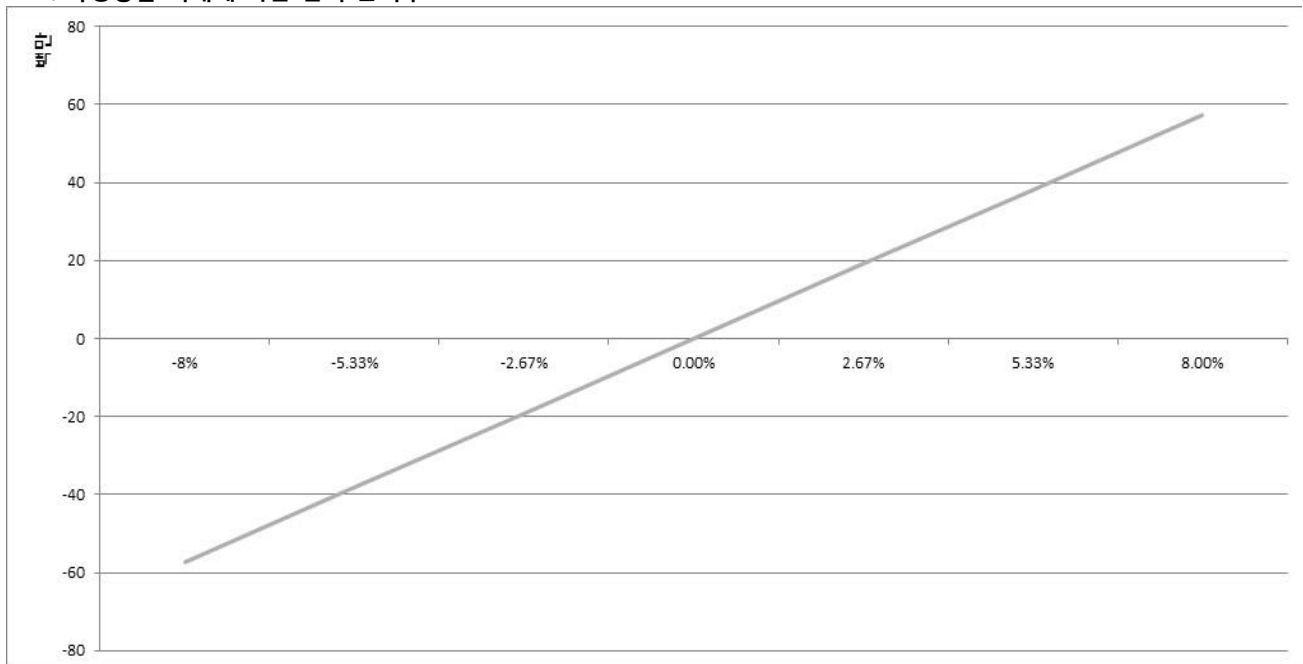
공시일: 2025-10-30

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 1,429  | 1,000 | 429       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 714    | 0     | 714       | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0      | 3,035 | -3,035    | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 74,692 | 0     | 74,692    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 0      | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 427    | 0     | 427       | 장내 |
| 합계 |      |      | 75,834 | 0     | 75,834    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

57

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6,855

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

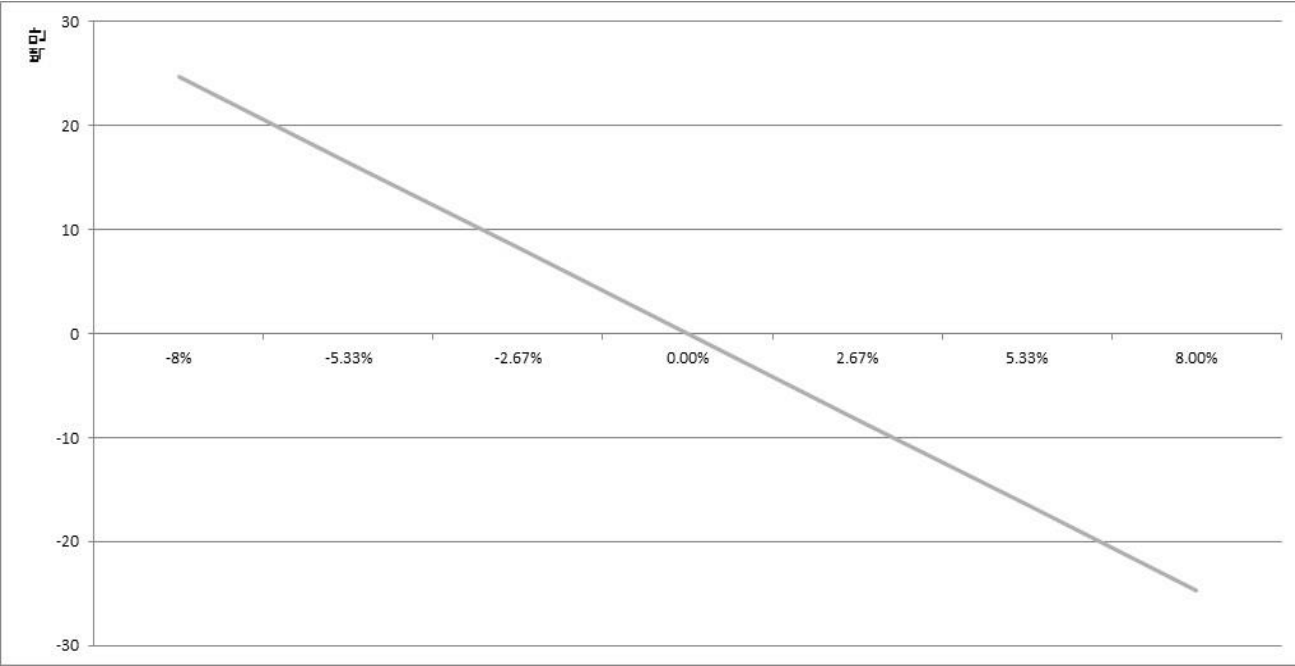
공시일: 2025-10-30

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     | 309   | -309      | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0     | 121   | -121      | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 1,896 | 0     | 1,896     | 장내 |
| 합계 |      |      | 1,896 | 309   | 1,586     |    |

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

210