

## 펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

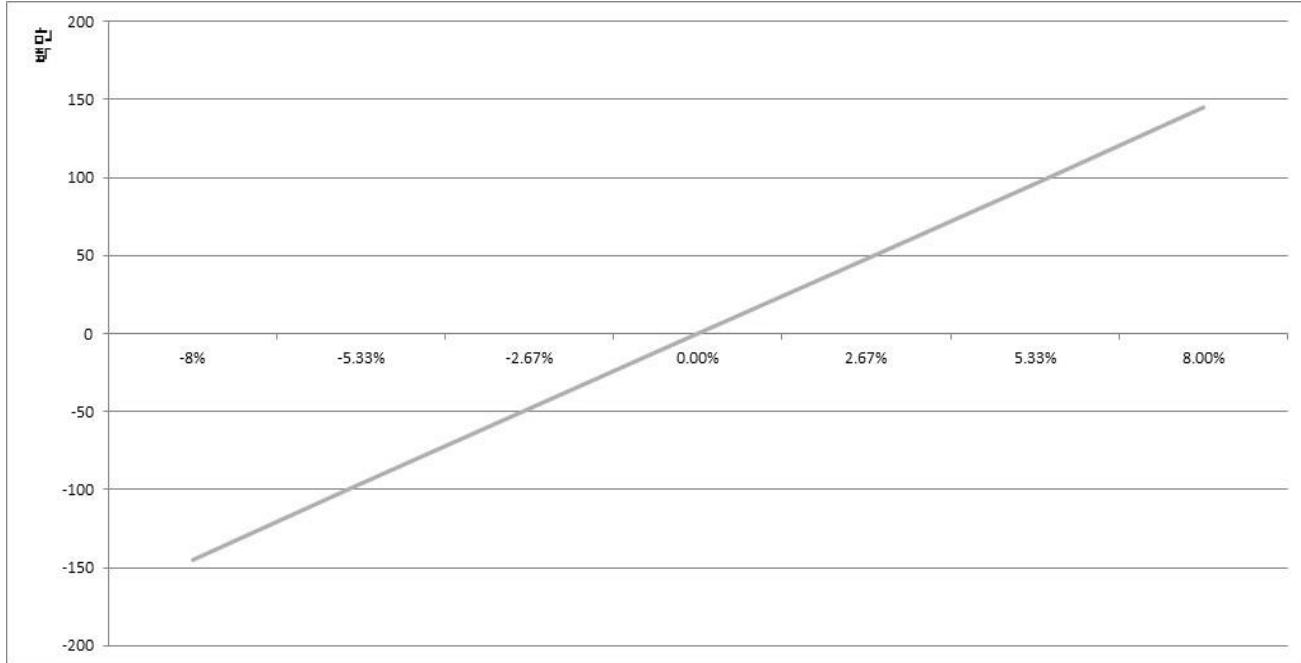
공시일: 2025-11-19

### 1. 계약금액

(단위: 백만원)

| 구분 | 거래대상 | 거래유형 | 매수(1)  | 매도(2) | 순포지션(1-2) | 비고 |
|----|------|------|--------|-------|-----------|----|
| 신규 | 주가지수 | 선물   | 974    | 0     | 974       | 장내 |
| 누계 | 주가지수 | 선물   | 1,808  | 0     | 1,808     | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 7      | 25    | -18       | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 66,744 | 0     | 66,744    | 장내 |
| 신규 | 유가증권 | 선물   | 18     | 0     | 18        | 장내 |
| 누계 | 유가증권 | 선물   | 19     | 0     | 19        | 장내 |
| 합계 |      |      | 68,571 | 0     | 68,571    |    |

### 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

### 3. 시나리오법에 의한 손익변동

145

(단위: 백만원)

### 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

6,316

# 펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

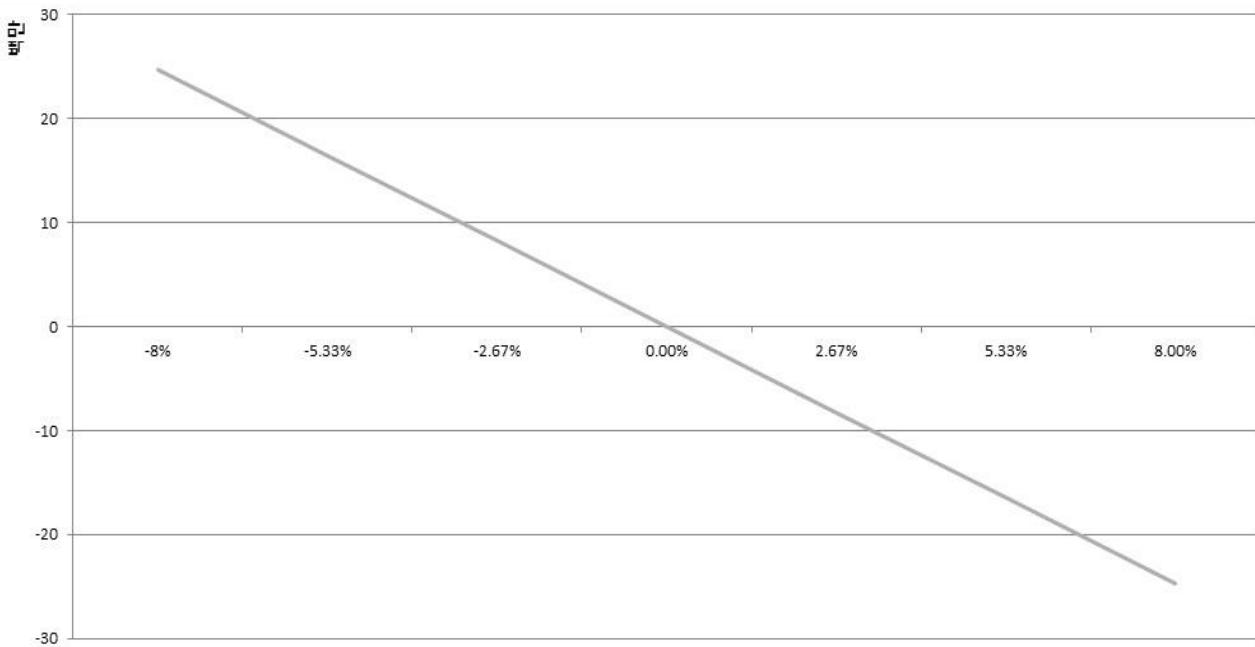
공시일: 2025-11-19

## 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     | 310   | -310      | 장내 |
| 신규 | 주식   | 주식   | 0     | 0     | 0         | 장내 |
| 누계 | 주식   | 주식   | 1,893 | 0     | 1,893     | 장내 |
| 합계 |      |      | 1,893 | 310   | 1,583     |    |

## 2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



## 3. 시나리오법에 의한 손익변동

(단위: 백만원)

25

## 4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

(단위: 백만원)

228