

펀드명 : 트러스톤인덱스알파[주식-파생형](모)

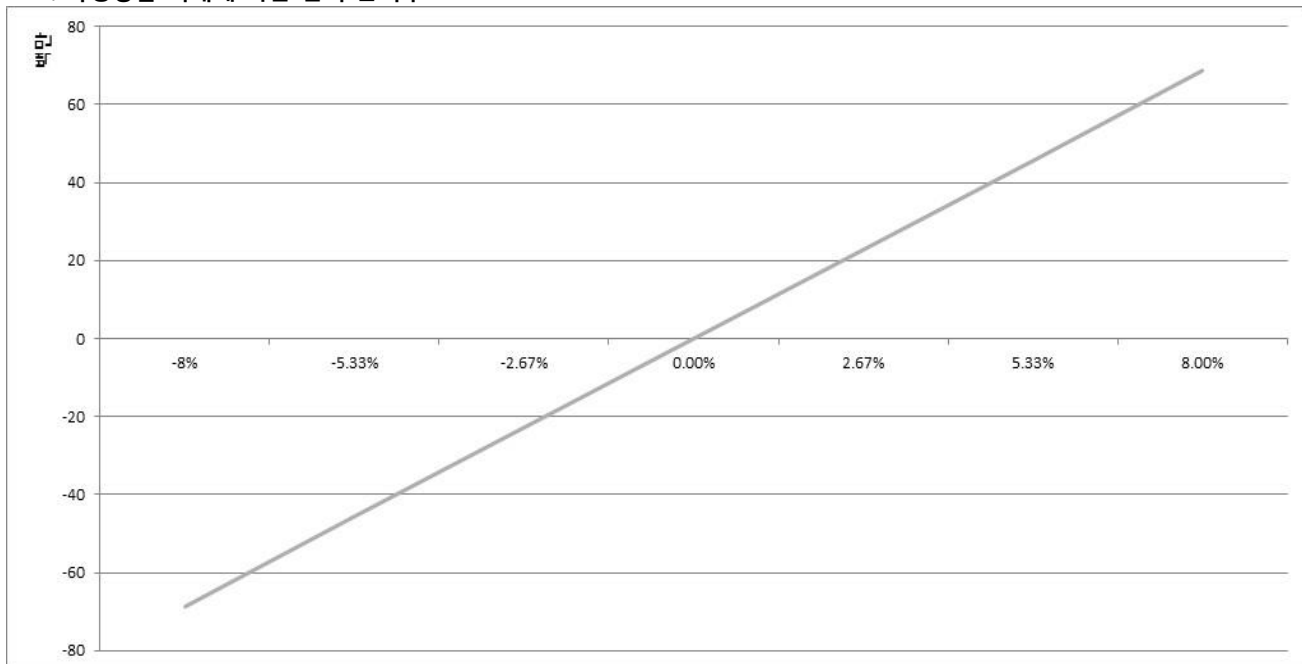
공시일: 2026-01-15

1. 계약금액

(단위: 백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	주가지수	선물	1,714	1,543	171	장내
누계	주가지수	선물	857	0	857	장내
신규	주식	주식	15	1,718	-1,703	장내
누계	주식	주식	74,343	0	74,343	장내
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	4	0	4	장내
합계			75,205	0	75,205	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

69

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

7,125

펀드명 : 트러스톤코스닥벤처공모주리츠[주식혼합-파생형]

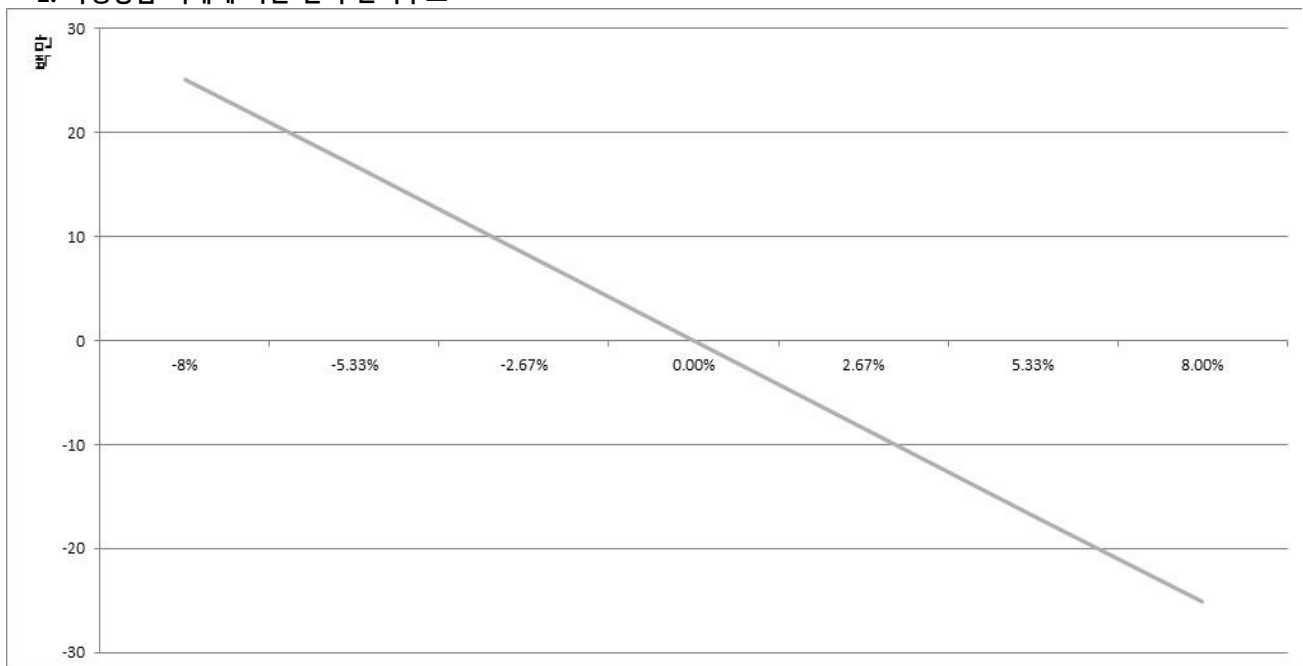
공시일: 2026-01-15

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	315	-315	장내
신규	주식	주식	0	0	0	장내
누계	주식	주식	1,072	0	1,072	장내
합계			1,072	315	757	

2. 파생상품 거래에 따른 만기 손익구조



(단위: 백만원)

3. 시나리오법에 의한 손익변동

25

(단위: 백만원)

4. 최대손실금액 (VaR : 99%, 10일)

114