

공시일: 2021-12-28
 자료기준일: 2021-12-27

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위: 백만원, %)

| 펀드명 | 파생상품 위험평가액 | NAV대비 비중 | 최대손실예상금액(VaR)* | NAV대비 비중 |
|------------------------------|------------|----------|----------------|----------|
| 지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁 | 881 | 7.3 | 356 | 2.9 |
| 지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁 | 1,719 | 8.3 | 768 | 3.7 |
| 지브이에이 Fortress-V 전문투자형사모투자신탁 | 473 | 4.5 | 149 | 1.4 |
| 지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁 | 58 | 1.2 | 13 | 0.3 |
| 지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁 | 24,219 | 8.4 | 9,753 | 3.4 |

* VaR : 99%신뢰수준,10일기준

2. 계산방법 : 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 제2-8조의3제2항 및 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙 제2조의3제5항에 의거하여 계산함.