

공시일: 2022-02-07  
자료기준일: 2022-02-04

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위: 백만원, %)

| 펀드명                          | 파생상품 위험평가액 | NAV대비 비중 | 최대손실예상금액(VaR)* | NAV대비 비중 |
|------------------------------|------------|----------|----------------|----------|
| 지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁    | 1,528      | 12.3     | 764            | 6.2      |
| 지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁    | 2,382      | 11.8     | 1,509          | 7.5      |
| 지브이에이 Fortress-V 전문투자형사모투자신탁 | 713        | 6.6      | 533            | 4.9      |
| 지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁    | 224        | 4.8      | 170            | 3.7      |
| 지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁 | 35,767     | 12.2     | 19,984         | 6.8      |

\* 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.