

공시일: 2022-06-03  
자료기준일: 2022-06-02

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위: 백만원, %)

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비 비중	최대손실예상금액(VaR)*	NAV대비 비중
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	1,376	10.3	1,457	10.9
지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁	2,014	9.2	2,617	11.9
지브이에이 Fortress-V 전문투자형사모투자신탁	514	4.8	1011	9.3
지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁	245	5.2	741	15.5
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	30,087	8.9	41,048	12.1

\* 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.