

공시일: 2023-01-25
자료기준일: 2023-01-20

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위: 백만원, %)

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비 비중	최대손실예상금액(VaR)*	NAV대비 비중
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	899	8.2	562	5.1
지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁	1,475	7.4	862	4.3
지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁	138	3.2	27	0.6
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	31,323	10.3	17,989	6.0

* 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.