공시일: 2023-04-10
자료기준일: 2023-04-07

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위: 백만원, %)

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비 비중	최대손실예상금액(VaR)*	NAV대비 비중
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	920	8.1	524	4.6
지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁	1,594	7.7	845	4.0
지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁	184	3.9	33	0.7
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	31,879	10.6	13,818	4.5

* 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.