

공시일: 2023-10-25
자료기준일: 2023-10-24

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위: 백만원, %)

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비 비중	최대손실예상금액(VaR)*	NAV대비 비중
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	817	7.3	928	8.3
지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁	1,188	6.2	1,541	8.0
지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁	113	2.3	24	0.5
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	24,391	9.1	23,630	8.8

* 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.