

공시일: 2024-04-22

자료기준일: 2024-04-19

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위: 백만원, %)

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비(%)	최대손실 예상(VaR)	NAV대비(%)
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	374	3.6	621	5.9
지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁	493	2.7	1,055	5.8
지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁	32	0.6	4	0.1
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	13,838	5.1	16,257	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.