

공시일: 2024-05-03

자료기준일: 2024-05-02

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위: 백만원, %)

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비(%)	최대손실 예상(VaR)	NAV대비(%)
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	530	5.0	674	6.4
지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁	764	4.2	1,148	6.3
지브이에이 Saber-E 전문투자형사모투자신탁	44	0.8	7	0.1
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	16,674	6.1	16,991	6.2

* 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.