

공시일: 2026-05-26

자료기준일: 2026-05-22

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비(%)	최대손실 예상(VaR)
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	546	5.8	701
지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁	1,262	5.5	1,521
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	23,754	4.9	32,466

* VaR : 99%신뢰수준,10일기준

2. 계산방법 : 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 제2-8조의3제2항 및 금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행령 제2조의3제5항에 의거하여 계산함.

(단위: 백만원, %)

NAV대비(%)
7.5
6.6
6.7

병세척