

공시일: 2026-06-01

자료기준일: 2026-05-29

**1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)**

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비(%)	최대손실 예상(VaR)
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	793	9.2	887
지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁	2,514	11.8	2,005
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	49,666	10.9	42,093

\* 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(%)
10.3
9.4
9.3

병세척