

공시일: 2026-06-05

자료기준일: 2026-06-04

**1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)**

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비(%)	최대손실 예상(VaR)
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	1,153	13.7	723
지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁	3,104	14.8	1,596
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	69,345	15.5	34,056

\* VaR : 99%신뢰수준,10일기준

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

(단위: 백만원, %)

NAV대비(%)
8.5
7.6
7.6

병세척