

공시일: 2026-07-21
자료기준일: 2026-07-20

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

펀드명	파생상품 위험평가액	NAV대비(%)	최대손실 예상(VaR)
지브이에이 Saber-G 전문투자형사모투자신탁	28	0.9	9
지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁	2,435	14.4	2,095
지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁	51,206	15.6	53,051

* 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(%)
0.3
12.3
16.2

별세척