공시일: 2026-11-17

자료기준일: 2026-11-16

**1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)**

(단위: 백만원, %)

| 펀드명 | 파생상품 위험평가액 | NAV대비(%) | 최대손실 예상(VaR) | NAV대비(%) |
|---|---|---|---|---|
| 지브이에이 Saber-V 전문투자형사모투자신탁 | 988 | 7.0 | 1,162 | 8.2 |
| 지브이에이 Fortress-A 전문투자형사모투자신탁 | 21,414 | 7.3 | 28,549 | 9.7 |
| | | | | |
| | | | | |

* 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.**