파생상품위험평가액 & VaR 공시

「금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙」별지 제67호에 의거 다음과 같이 공시 합니다.

공 시 일: 2026-03-09
자료기준일: 2026-03-06

- 다 음 -

1. 파생상품 위험평가액 및 최대손실예상금액(VaR)

(단위:백만원,%)

펀 드 명	파생상품위험평가액	NAV대비 비중	파생상품최대손실예상금액 (VaR)*	NAV대비 비중
빌리언폴드 Billion Beat-EH 일반사모투자신탁	0	0.00	0	0.00
빌리언폴드 Billion Beat-RV 일반사모투자신탁	0	0.00	0	0.00
빌리언폴드 Billion Beat-ED 일반사모투자신탁	0	0.00	0	0.00
빌리언폴드 Billion Beat-MS 일반사모투자신탁	0	0.00	0	0.00
빌리언폴드 Billion Beat-LS 일반사모투자신탁	0	0.00	0	0.00
빌리언폴드 Billion Beat-MN 일반사모투자신탁	0	0.00	0	0.00
빌리언폴드 Billion Beat-LV 일반사모투자신탁	0	0.00	0	0.00
빌리언폴드 Billion Beat-AR 일반사모투자신탁	0	0.00	0	0.00

*VaR : 99%신뢰수준, 10일 기준

2. 계산방법 : 「금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정」제2-8조의3제2항 및 「금융투자회사의 영업 및 업무에 관한 규정 시행세칙」제2조의3제5항 및 별지 제67호에 의거하여 계산

1) 파생상품위험평가액 산정방법 : 금융투자업규정 제4-54조 제1항 및 제2항에 따른 현행 '파생상품 위험평가액 산정방법'을 준용하되, 조건이 충족될 경우 스왑, 국내외 장내 주가지수선물 및 개별주식선물의 위험평가액을 차감한 금액

2) 최대손실예상금액(VaR)산정방법 : 금융투자업규정 4-71조에 따른 값 (신뢰수준 99%, 10영업일 기준 등)을 준용하되, 조건이 충족될 경우 스왑, 국내외 장내 주가지수선물 및 개별주식선물의 위험평가액을 차감한 금액 (사무관리회사, 채권평가회사별 모델 활용 및 위탁도 가능)