

100 年度風險值資訊

(一) 市場風險

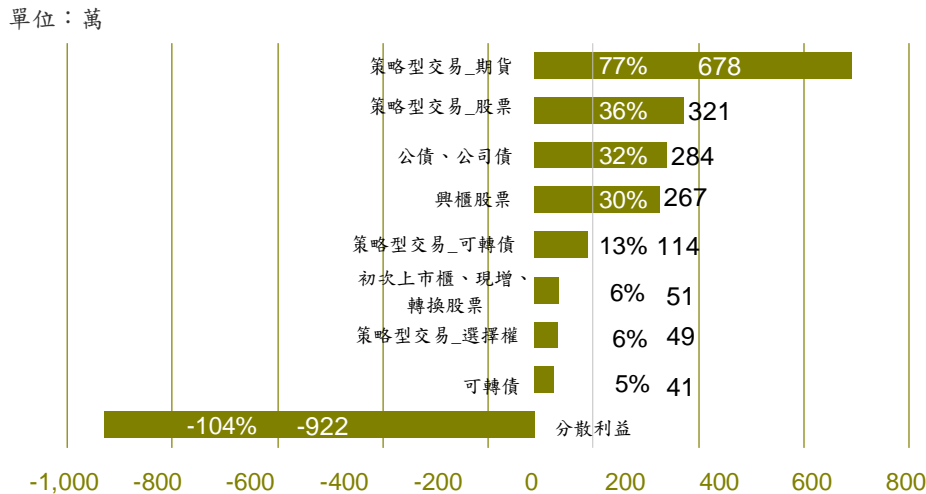
- ☑ 部位授權管理：訂定各業務/商品部位之部位限額、並透過下單系統管理，逾授權限額之委託單無法下單。
- ☑ 超缺避管理：訂定認購(售)權證之避險部位權限。
- ☑ 風險值管理：盤中進行初算、盤後以 Bloomberg 之「VAR」進行風險值運算。
- ☑ 警示/停損管理：設定各部位之警示、停損檢核點。
- ☑ 盤中即時監控系統：以即時監控系統管理各部位之風險值、損益與認購(售)權證之超缺避部位。

1. 風險值分析

全公司風險值分析

- ☑ 100/12/30 全公司 VaR 值為 883 萬，佔率最高為(策略型交易_期貨)77%，整體互抵效果達 104%。

國泰證券投資部位95%風險值分析



- ☑ VaR/ VaR Limit 為 7.36%(VaR Limit 設定為 1.2 億，約佔公司淨值之 3%)。

- ☑ 100 年 1~12 月全公司風險值

