

# 102 年上半年度風險值資訊

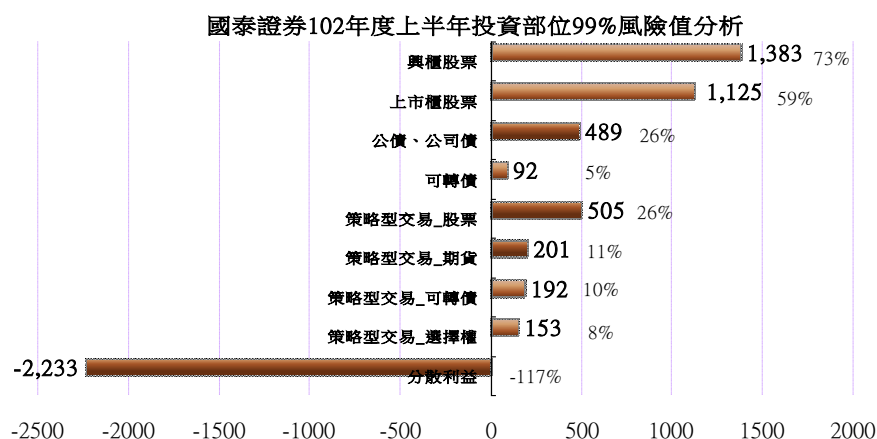
## (一) 市場風險

- ☑ 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「PORT」系統進行風險值運算。
- ☑ 警示/停損管理：設定各部位之警示、停損檢核點，並將風險限額警示、停損監控程式化於 5/21 上線。
- ☑ 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

- ☑ 102/6/28 全公司 VaR 值為 1,907 萬，方向性交易佔率最高為興櫃股票，佔率 73%。



- ☑ VaR/ VaR Limit 為 9.82%(VaR Limit 設定為 1.94 億，約佔公司淨值之 4.2%)。
- ☑ 本公司 102 年上半年每日 99%1 日 VaR 均符合總風險限制(即公司淨值之 4.2% 以下)，且皆為低度風險區間(低於公司淨值之 2.8%)。
- ☑ 102 年 1~6 月全公司風險值

