

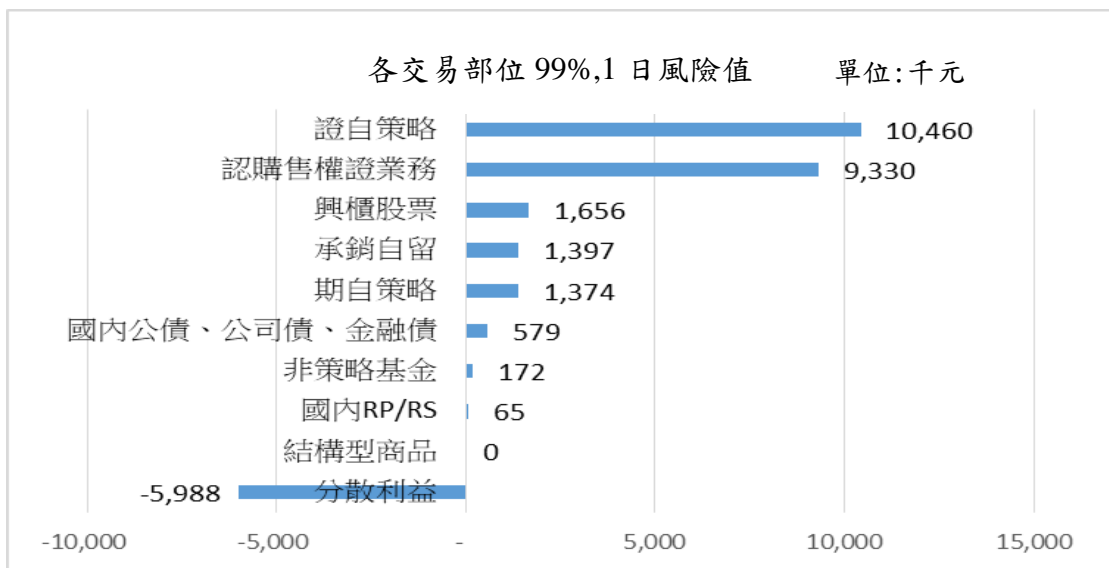
2019 上半年度風險值資訊

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。
- ☑ 風險值管理：盤中進行初算、盤後以「ALGO 金控集團風險管理系統」進行風險值運算。
- ☑ 警示/停損管理：利用風險限額警示、停損監控程式檢視各部位之警示、停損檢核點。
- ☑ 超缺避管理：訂定認購(售)權證與結構型商品之避險部位權限。
- ☑ 盤中即時監控系統：以即時監控系統管理各部位之控管點。

風險值分析-全公司風險值分析：

2019/06/28 全公司 99%,1 日風險值為 1,904 萬，各交易部位風險值最高者為證自策略部位 1,046 萬，其次為認購售權證業務 933 萬，分散利益為 599 萬。



註：分散利益大係因本公司各交易部位操作屬性相異，多數交易部位間之報酬相關性多屬低度相關或負相關，故而產生之風險抵減效果。

- ☑ 本公司 2019 年度每日 99%,1 日風險值均符合風險限額(2018 年底公司淨值之 4.2%，相當於 3.24 億元)，且皆為低度風險區間(低於公司淨值之 2.8%)。

