

# 101 年度風險值資訊

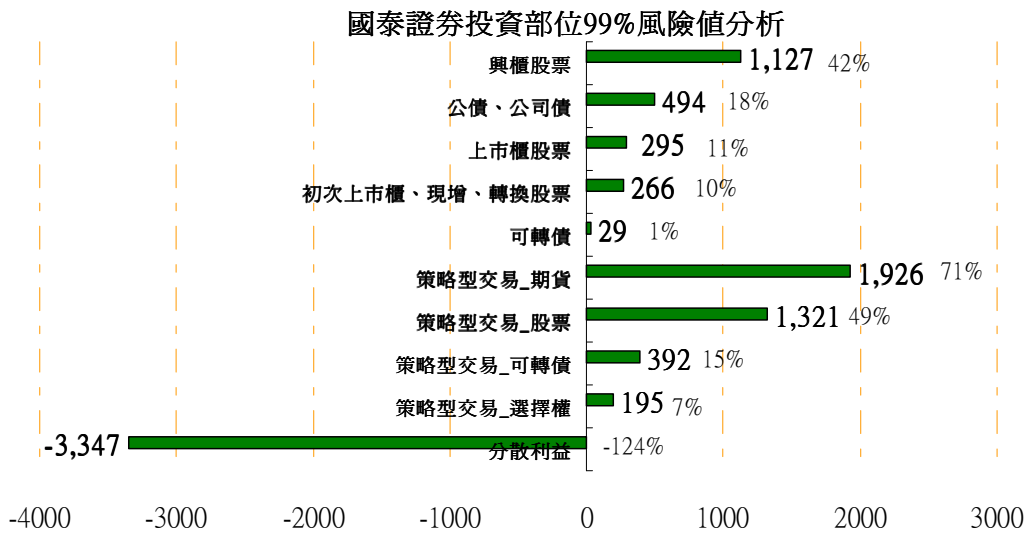
## (一) 市場風險

- ☑ 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

- ☑ 101/12/28 全公司 VaR 值為 2698 萬，除策略型交易外，佔率最高者為興櫃股票(42%)，整體互抵效果達 124%。



- ☑ VaR/ VaR Limit 為 16.06%(VaR Limit 設定為 1.68 億，約佔公司淨值之 4.2%)。

- ☑ 101 年 1~12 月全公司風險值

