

## 風險值(VaR)：

本公司使用風險值(VaR)模型進行市場風險之整合量化管理，對市場風險進行衡量與監控。本公司115年度之風險值係以歷史模擬法模型(Historical Simulation Method)99%之信賴水準，計算未來一日潛在最大損失金額；且針對市場風險值模型定期進行回溯測試，以驗證模型之準確性。本公司115年3月31日市場總風險值約為新臺幣115,306千元，約佔淨值0.98%，符合本公司規定。

單位：新臺幣仟元

資料時間	風險值	佔淨值
115.03.31	115,306	0.98%
114.12.31	108,215	1.08%
114.09.30	105,531	1.06%
114.06.30	116,802	1.29%