

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114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114年06月30日市場總風險值約為新臺幣116,802千元，約佔淨值1.29%，符合本公司規定。

單位：新臺幣仟元

| 資料時間 | 風險值 | 佔淨值 |
|-----------|---------|-------|
| 114.06.30 | 116,802 | 1.29% |
| 114.03.31 | 45,265 | 0.50% |
| 113.12.31 | 47,440 | 0.59% |
| 113.09.30 | 43,862 | 0.55% |
| 113.06.28 | 46,892 | 0.61% |