

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112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112年12月29日市場總風險值約為新臺幣27,410仟元，約佔淨值0.40%，符合本公司規定。

單位：新臺幣仟元

資料時間	風險值	佔淨值
112.12.29	27,410	0.40%
112.09.28	30,491	0.44%
112.06.30	25,756	0.38%
112.03.31	23,050	0.34%
111.12.30	17,387	0.27%