

۳-۹- میزان سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار

با توجه به محاسبات صورت گرفته در مدیریت ریسک بر اساس روش واریانس - کواریانس، ارزش در معرض خطر ده روزه نرخ ارز در سطح اطمینان ۹۹ درصد معادل ۴,۹۳۷ میلیارد ریال می باشد. با عنایت به محاسبات صورت گرفته بر مبنای توصیه های بال حداقل میزان ذخیره سرمایه ریسک نرخ ارز ۱۴,۸۱۱ میلیارد ریال است.

جدول میزان سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار مقطع منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹

روش اندازه گیری	ریسک سهام*		ریسک ارز		مجموع سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار
	ارزش در معرض خطر	سرمایه مورد نیاز	ارزش در معرض خطر	سرمایه مورد نیاز	
مدل واریانس - کواریانس**	میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال
	-	-	۴,۹۳۷,۰۵۲	۱۴,۸۱۱,۱۵۶	۱۴,۸۱۱,۱۵۶

*سهم سریع معامله در بد بانک کم اهمیت بوده و بانک به صورت روزانه مبادرت به خرید و فروش سهام نمی نماید.
** مطابق مفاد مجموعه مروری بر ادبیات ریسک بازار، روش مذکور مورد قبول نهاد ناظر بانکی می باشد