

میزان سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار

با توجه به محاسبات صورت گرفته در مدیریت ریسک براساس روش واریانس و کواریانس، ارزش در معرض خطر ده روزه نرخ ارز در سطح اطمینان ۹۹ در صد معادل ۱۹/۵۹۲ میلیارد ریال می‌باشد. با عنایت به محاسبات صورت گرفته بر مبنای توصیه های بال حداقل میزان ذخیره سرمایه ریسک نرخ ارز ۵۹/۳۴۲ میلیارد ریال است.

جدول میزان سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار مقطع منتهی به ۱۴۰۰/۱۲/۲۹

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	
	میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال
مدل واریانس - کوواریانس	۶,۲۳۸,۶۶۵	۱۸,۷۱۵,۹۹۴	۱۳,۵۴۲,۲۹۷	۴۰,۶۲۶,۸۹۱	۵۹,۳۴۲,۸۸۵