

## میزان سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار

با توجه به محاسبات صورت گرفته بر اساس روش شبیه سازی تاریخی، ارزش در معرض خطر ده روزه نرخ ارز در سطح اطمینان ۹۹ درصد معادل ۶۵,۸۴۲ میلیارد ریال می‌باشد. با عنایت به محاسبات صورت گرفته بر مبنای توصیه های بال حداقل میزان ذخیره سرمایه ریسک سهام و نرخ ارز در مقطع منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۲، ۱۹۷,۵۲۶ میلیارد ریال است.

مجموع سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار	ریسک ارز		ریسک سهام		روش اندازه گیری
	سرمایه مورد نیاز	ارزش در معرض خطر	سرمایه مورد نیاز	ارزش در معرض خطر	
میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	میلیون ریال	
۲۳۷,۵۷۹,۷۱۳	۲۳۷,۵۷۹,۷۱۳	۷۹,۱۹۳,۲۳۸	۰	۰	مدل واریانس-کوواریانس (۹۵درصد)
۱۹۷,۵۲۶,۲۱۰	۱۹۷,۵۲۶,۲۱۰	۶۵,۸۴۲,۰۷۰	۰	۰	مدل شبیه سازی تاریخی (۹۵درصد)

تجربه ای متمایز