

۳-۹ میزان سرمایه لازم برای پوشش ریسک بازار

طبق مقررات بانک مرکزی، سرمایه لازم بانک برای پوشش ریسک بازار توسط واحد مالی و در چارچوب محاسبات کفایت سرمایه انجام می‌گیرد.

جمع دارایی‌های موزون به ریسک بازار: ۶۴,۶۶۹,۱۴۲ میلیون ریال

حداقل نسبت کفایت سرمایه قابل قبول: ۸٪

سرمایه لازم برای پوشش ریسک بازار: بر اساس محاسبات صورت گرفته بر مبنای روش تک‌دارایی، سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار ۱۱,۶۸۳,۵۴۴ میلیون ریال و با استفاده از روش واریانس_کوواریانس سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار ۱۰,۴۳۰,۹۶۲ میلیون ریال می‌باشد.

• لازم به ذکر است که واحد ریسک به طور مستقل و بر اساس دستورالعمل‌های بازل نیز سرمایه مورد نیاز را محاسبه می‌نماید.