۹-۳ 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: ۴۷،۶۶۶،۴۷۶ 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 ۸،۳۲۲،۲۷۳ میلیون ریال و با استفاده از روش واریانس _کوواریانس سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار ۵،۹۰۹،۸۴۷ 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.