

## 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 ۳۰/۰۳۳ 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 ۱۴۰۱، ۹۱/۰۰۷ 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	مدل شبیه سازی تاریخی
۹۱.۰۰۷.۹۳۲	۹۰.۰۷۰.۰۹۶	۳۰.۰۳۳.۳۶۵	۹۳۷.۸۳۶	۳۱۳.۶۱۲	

بانک ملت  
bank mellat

تجربه ای متمایز