

۹-۲- روش سنجش ریسک بازار

با توجه به این که فعالیت های ارزی بانک هنوز محدود به فعالیت های مرحله اول مجوز ارزی است. این بانک در حال مطالعه برای چگونگی پیاده سازی سیستمی برای مدیریت ریسک بازار قرار دارد.

البته پایش حدود مقرر بانک مرکزی در این خصوص مثل وضعیت باز ارزی، نسبت تعهدات و بدهی های ارزی به دارایی های ارزی دارایی ها از جمله مواردی هستند که برای کنترل اکسپوزهای ریسک بازار ناشی از نوسانات نرخ ارز مورد استفاده قرار می گیرند.

افزون بر این، در حال حاضر پایش حدود مربوط به سرمایه گذاری در اوراق بهادار (از جمله در سهام شرکت های بورسی و غیر بورسی ) به منظور رعایت حدود مقرر بانک مرکزی به طور منظم انجام می شود.