

سرمايه مورد نياز براي پوشش ريسك بازار:

با توجه به اين كه بانك مركزي تا كنون مقررات كفايت سرمايه را بر اساس تفاهم نامه بازنگري شده بازل ۱ در سال ۱۹۹۶ اصلاح نكرده است از اين رو، الزام قانوني اي براي نگه داري سرمايه به منظور پوشش ريسك بازار وجود ندارد. بنا بر اين ، نسبت كفايت سرمايه بر اساس تفاهم نامه بازل ۱ ، آن هم بدون احتساب ريسك بازار محاسبه مي شود.

البته از آنجايي كه فعاليت ارزي بانك در چارچوب مجوز مرحله اول اخيرا آغاز شده است، به منظور بستر سازي براي اندازه گيري و پايش منابع در معرض ريسك بازار ، مطالعه چگونگي مديريت اين ريسك شامل شناسايي، اندازه گيري و ارزيابي و نيز پايش آن در دستور كار مديريت امور ريسك قرار گرفته است.