

ماده ۹-۲: روش سنجش ریسک بازار

در خصوص ارزیابی ریسک بازار بانک آینده، مدل RISKMETRICS شرکت جی پی مورگان بر اساس روش Value at Risk جهت ارزیابی ریسک پرتفوی سهام و وضعیت ارزی بانک مورد استفاده قرار می‌گیرد. در این روش، بیشترین زیان احتمالی بانک در سبد سهام در اختیار یا وضعیت ارزی مورد نظر خود را در بازه‌های زمانی آینده مورد گزارش قرار می‌دهد.