

## تحلیل ارزش در معرض خطر سرمایه گذاری در سهام و سایر سرمایه گذاری های دارای

### ریسک بازار

با توجه به پیش بینی تغییرات قیمت بازار سهام و سرمایه گذاری های دارای قیمت بازار موجود در پورتفوی دارایی های بانک با استفاده از روش تاریخی، میزان ارزش در معرض خطر برای سرمایه گذاری در سهام و سایر سرمایه گذاری های دارای قیمت بازار، برای سال جاری مطابق جدول ذیل می باشد:

### جدول تحلیل ارزش در معرض خطر سرمایه گذاری در سهام و سایر سرمایه گذاری های دارای ریسک بازار

مقطع منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

نوع سرمایه گذاری	۱۴۰۰			۱۴۰۱		
	تغییر احتمالی در قیمت بازار	تأثیر در سود و زیان	مبلغ	تغییر احتمالی در قیمت بازار	تأثیر در سود و زیان	مبلغ
	درصد	میلیون ریال	میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	میلیون ریال
سرمایه گذاری در سهام سریع معامله	(۱۷/۰۸ و ۶/۲)	۹,۷۴۶,۰۲۱	۸۹,۵۷۷,۴۰۰	(۴۰ و ۲)	۱,۳۸۳,۱۲۶	۷,۳۷۹,۶۱۳
اوراق بهادار لروزی	۰	۴۲	۴,۳۴۶	(۲ و ۰)	۹۷۱	۹۷,۰۵۸
اوراق مشارکت بخش دولتی	۰	۰	۶۵,۵۴۴,۰۳۴	۰	۰	۲۵۴,۶۶۶,۶۳۷
اوراق مشارکت بخش غیر دولتی	۰	۰	۹,۱۹۴,۶۳۳	۰	۰	۱۳۹,۸۷۴,۲۴۱
اوراق بهادار دولتی شعب خارج از کشور	۰	۰	۰	۰	۰	۰
اوراق بهادار خصوصی شعب خارج از کشور	۰	۰	۰	۰	۰	۰
جمع	۰	۹,۷۴۶,۰۶۳	۱۶۴,۴۴۰,۳۱۲	۰	۱,۳۸۴,۰۹۷	۴۰۱,۹۱۷,۵۴۹



## جدول تحلیل ارزش در معرض خطر طلا، نقره و پلاتین منتهی به ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

۱۴۰۰	۱۴۰۱	
میلیون ریال	میلیون ریال	
۱۱,۴۳۰,۱۶۹	۱۲,۱۳۰,۰۴۲	جمع دارایی‌ها به طلا، نقره و پلاتین
.	.	جمع بدهی‌ها به طلا، نقره و پلاتین
۱۱,۴۳۰,۱۶۹	۱۲,۱۳۰,۰۴۲	خالص دارایی‌ها و بدهی‌ها به طلا، نقره و پلاتین
.	.	جمع تعهدات مشتریان به طلا، نقره و پلاتین
.	.	جمع تعهدات موسسه اعتباری به طلا، نقره و پلاتین
.	.	خالص تعهدات به طلا، نقره و پلاتین
۱۱,۴۳۰,۱۶۹	۱۲,۱۳۰,۰۴۲	خالص وضعیت باز طلا
۱۱,۴۳۰,۱۶۹	۱۲,۱۳۰,۰۴۲	خالص وضعیت باز طلا (همواره مثبت)
۱۰۰٪	۶۷٪	وضعیت باز طلا به سرمایه پرداخت شده و اندوخته آزاد (درصد)

## تحلیل تاثیر ریسک نرخ ارز بر سود و زیان ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

بر مبنای روش واریانس و کواریانس و با توجه به تغییرات احتمالی در نرخ ارز، میزان ارزش در معرض خطر برای خالص دارایی‌ها و بدهی‌های ارزی در جدول زیر ارائه شده است:

## جدول تحلیل تاثیر ریسک نرخ ارز بر سود و زیان ۱۴۰۱/۱۲/۲۹

نوع ارز	۱۴۰۰			۱۴۰۱		
	تخمین احتمالی در سطح بالا و پایین تاثیر در سود و زیان	میانگین	میانگین	تخمین احتمالی در سطح بالا و پایین تاثیر در سود و زیان	میانگین	میانگین
دلار آمریکا	۱۰۰-۱۲۱۵	۵۸۴,۲۱۵	۴۶۷,۳۷۲	۸۱۹,۸۲۹-۱,۱۲۹,۹۲۶	۱۶۵,۰۴۸	۱,۱۲۹,۹۲۶
یورو	۹۱۸۹-۱۲۶۴	۵,۹۸۹	۹۷۸,۰۵۰	۳,۶۲۴-۶۹۰,۰۰۰	۱۴,۵۳۵,۰۱۱	۱,۰۲۰,۷۲۲,۱۶۲
یونگ	۸۴۴-۱۲۴۵	۶,۷۸۱	۱۱۶,۰۹۰	۷,۶۸۵-۱۰,۷۶۴	۱,۵۳۹	۱۰,۷۶۴
فرانک	۷۳۷-۱۵۷۹	۲,۶۴۷	۵,۶۴۸	۱,۲۰۸-۶۵,۸۲۵	۳۲,۳۰۸	۶۵,۸۲۵
بن ژاپن	۱۳-۸۷۵	۱۴,۲۸۵	۷۲۶,۵۳۸	۸۵۵,۰۴۵-۱,۲۰۸,۷۹۱	۱۷۶,۸۸۴	۱,۲۰۸,۷۹۱
درهم امارات	۱۰-۱۲۱۵	۸۰,۳۸۱,۵۶	۶,۲۲۰,۵۲۵	۶,۵۸۹,۲۱۲-۶,۵۷۱,۶۴۴	۹۲۲,۳۳۴	۶,۵۸۹,۲۱۲
جمع				جمع	۱۲,۹۶۷,۵۶۷	
					۹,۵۶۲,۸۲۴	