

**بانک ملت (سهامی عام)**  
**یادداشت های توضیحی صورتهای مالی**  
**سال مالی منتهی به ۲۹ اسفند ۱۴۰۱**

**۵-۶۰- تحلیل ارزش در معرض خطر نرخ ارز**

وضعیت داراییها و بدهی ها و تعهدات ارزی در پایان ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ به شرح زیر است:

یادداشت	دلار آمریکا	یورو	پوند انگلیس	فرانک سوئیس	ون کره	لیر ترکیه	ین ژاپن	درهم امارات	یوان چین	سایر ارزها
۲۶	۴۶۱,۳۶۹,۰۱۴	۶۶۸,۸۳۷,۴۰۴	۲,۳۷۵	۱,۱۷۱,۹۲۶	۴۳,۷۸۰,۷۲۸,۰۴۱	۱,۱۹۲,۶۰۷,۸۶۰	۱,۳۲۳,۴۶۵,۷۰۴	۸۷۶,۶۶۲,۴۴۹	۷۴۴,۷۸۶,۴۹۲	
۲۷	۶,۹۵۳,۳۰۵	۶۷۳,۷۱۹,۱۳۰	۱,۴۰۴,۹۲۸	۱۸	۳,۶۴۲,۷۷۸,۴۶۳,۷۲۳	۳۳,۰۸۲,۲۰۹	۷,۴۹۵,۴۱۴,۷۱۳	۱,۶۹۴,۷۳۳,۱۴۷	۲,۲۴۰,۳۳۱,۱۴۰	
۲۹	۱,۱۴۱,۸۷۲,۸۸۵	۱۲,۰۸۴,۰۷۷,۲۳۰	.	.	.	.	۸۰,۴۳۹,۰۳۳۸	۷۵,۴۱۳,۰۷۹	۷,۳۶۹,۳۸۹,۷۶۴	
۳۰	۹,۱۵۴,۴۵۷	۸۸۵,۱۱۴,۲۲۶	(۵۳,۰۲۴)	۵۵۹,۷۱۳	۲۲۵,۲۷۴,۷۰۳,۴۲۷	۲۷۶,۷۰۳,۷۱۵	۱,۲۹۲,۵۶۴,۵۴۱	۱۲۲,۸۹۵,۳۷۰	۳۳۹,۹۳۵,۰۲۲	
۳۳	.	.	.	.	.	۷,۴۵۶,۸۰۰	.	.	.	
۳۱	.	.	.	.	.	.	.	.	.	
۳۲	۴۱,۷۰۶	۲۱۵,۵۵۸	۱	.	۲۷۸,۰۰۲۲,۳۳۹	۷,۶۲۹,۹۵۸	۲۶	.	.	
۳۷	.	.	.	.	.	۲۱۹,۶۹۳,۳۰۰	.	.	.	
۳۸	.	(۲۴۵,۲۶۳)	.	.	.	۲۸۶,۴۸۵	.	.	۵,۶۹۴,۶۴۰,۵۵۸	
جمع دلاری های ارزی	۱,۶۱۹,۳۹۱,۳۶۷	۱۴,۳۱۱,۷۱۸,۲۸۵	۱,۳۵۴,۱۸۰	۱,۷۳۱,۶۵۷	۳,۹۱۲,۱۱۱,۹۱۷,۵۳۹	۱,۷۳۷,۴۶۰,۳۲۶	۱۰,۹۱۵,۸۳۵,۳۲۲	۲,۷۶۹,۷۰۴,۰۴۶	۱۶,۳۸۹,۱۸۲,۹۷۵	
۵۵-۱	۳,۸۳۶,۹۲۷	۹۲۵,۰۶۹,۴۲۷	.	.	.	۱,۹۹۲,۰۲۵	۱۹,۸۴۰,۶۲۵	۱۲,۶۹۴	۲,۷۳۸,۱۶۱,۹۲۴	
۵۵-۲	۵۵,۴۹۹,۸۲۵	۶۱۹,۶۹۴,۳۶۵	۱,۸۴۰	.	.	۱۷,۴۷۹,۶۶۹	.	۵,۸۲۱,۰۹۶	۲۱۲,۱۵۳,۴۱۶	
۵۵-۳	۹۱۷,۳۷۵,۹۴۶	۵۳۰,۳۶۸,۹۲۹	.	.	.	.	.	.	۱۰۵,۷۳۰,۷۶۷	
جمع تعهدات ارزی مشتریان	۹۷۶,۷۱۲,۶۹۸	۲,۰۷۵,۱۳۲,۷۲۱	۱,۸۴۰	.	.	۱۹,۴۷۱,۶۹۴	۱۹,۸۴۰,۶۲۵	۵,۸۳۳,۷۹۰	۳,۰۵۶,۰۴۶,۱۰۷	
جمع دلاریهای ارزی و تعهدات ارزی مشتریان	۲,۵۹۶,۱۰۴,۰۶۵	۱۶,۳۸۶,۸۵۱,۰۰۶	۱,۳۵۶,۰۲۰	۱,۷۳۱,۶۵۷	۳,۹۱۲,۱۱۱,۹۱۷,۵۳۹	۱,۷۵۶,۹۳۲,۰۲۰	۱۰,۹۳۵,۶۷۵,۸۴۷	۲,۷۷۵,۵۳۷,۸۳۶	۱۹,۴۴۵,۲۲۹,۰۸۲	
معادل ریالی جمع دلاریهای ارزی و تعهدات ارزی مشتریان-میلیون ریال	۶۴۰,۸۳۰,۱۱۹	۴,۲۲۷,۵۳۰,۹۹۹	۴۰۸,۵۲۵	۴۶۳,۵۵۹	۷۰۰,۳۴۰,۹۹۹	۲۲,۷۷۳,۵۳۴	۱۶,۷۸۸,۶۵۹	۵,۸۲۲,۸۰۵	۶۸,۹۹۵,۹۰۰	۵۸,۵۴۶,۵۶۲
۴۰	(۱۳۶,۰۵۲,۹۰۳)	(۳,۲۴۲,۴۶۶,۲۵۳)	(۷۷۶,۴۲۲)	(۲۱,۴۲۰)	(۳,۰۱۱,۲۷۴,۷۸۳)	(۹۵,۵۵۳,۰۵۶)	(۱۰۶,۰۵۵,۶۸۲)	(۵۶,۶۶۹,۴۸۱)	(۶۸۵,۹۴۹,۸۲۵)	
۳۹	(۲۰۳,۷۴۴,۵۵۶)	(۶۴۹,۴۲۴,۷۷۹)	(۱۶۹,۳۷۲)	(۵۸۱,۷۶۷)	(۳,۳۶۸,۶۰۴,۴۱۸,۱۱۴)	(۲۲۷,۸۷۵,۸۶۲)	(۲,۷۲۲,۸۵۹,۱۷۹)	(۳۷۷,۵۵۳,۹۶۴)	(۶۱۱,۲۴۲,۵۰۹)	
۴۳	(۸۸۵,۸۵۴,۴۸۸)	(۴,۹۸۰,۲۱۲,۷۰۲)	(۱۳۴,۳۹۳)	(۱)	(۳۵۳,۷۴۰,۹۲۹,۸۶۰)	(۷۳۱,۸۸۴,۰۴۱)	(۳,۰۳۲,۰۳۲,۹۵۹)	(۱,۷۶۸,۳۷۴,۴۵۶)	(۱۲,۸۸۳,۰۰۱,۵۲۶)	
حقوق صاحبان سپردههای سرمایه گذاری	(۳۲۴,۸۸۱,۰۸۷)	(۹۸۵,۲۲۲,۳۶۳)	.	.	(۷۰۰,۰۳,۹۱۸)	(۸۸,۳۹۳)	(۹,۸۱۶,۹۸۵)	(۱۳۰,۷۶۲,۴۸۸)	.	
جمع بدهیهای ارزی	(۱,۵۵۰,۵۳۳,۰۳۴)	(۹,۸۵۷,۳۲۶,۰۹۸)	(۱,۰۸۰,۱۸۶)	(۶۰۳,۱۸۸)	(۳,۷۲۵,۳۶۳,۶۲۶,۶۷۵)	(۱,۰۶۵,۴۰۱,۳۵۲)	(۵,۸۷۱,۷۶۴,۸۰۵)	(۲,۳۳۳,۳۶۰,۳۸۸)	(۱۴,۱۸۰,۱۹۳,۸۶۰)	
۵۵-۱	(۳,۸۳۶,۹۲۷)	(۹۲۵,۰۶۹,۴۲۷)	.	.	.	(۱,۹۹۲,۰۲۵)	(۱۹,۸۴۰,۶۲۵)	(۱۲,۶۹۴)	(۲,۷۳۸,۱۶۱,۹۲۴)	
۵۵-۲	(۵۵,۴۹۹,۸۲۵)	(۶۱۹,۶۹۴,۳۶۵)	(۱,۸۴۰)	.	.	(۱۷,۴۷۹,۶۶۹)	.	(۵,۸۲۱,۰۹۶)	(۲۱۲,۱۵۳,۴۱۶)	
۵۵-۳	(۹۱۷,۳۷۵,۹۴۶)	(۵۳۰,۳۶۸,۹۲۹)	.	.	.	.	.	.	(۱۰۵,۷۳۰,۷۶۷)	
جمع تعهدات ارزی بانک	(۹۷۶,۷۱۲,۶۹۸)	(۲,۰۷۵,۱۳۲,۷۲۱)	(۱,۸۴۰)	.	.	(۱۹,۴۷۱,۶۹۴)	(۱۹,۸۴۰,۶۲۵)	(۵,۸۳۳,۷۹۰)	(۳,۰۵۶,۰۴۶,۱۰۷)	
جمع بدهی های ارزی و تعهدات ارزی بانک	(۲,۵۲۷,۲۴۵,۷۳۲)	(۱۱,۹۳۲,۴۵۸,۸۱۸)	(۱,۰۸۲,۰۲۶)	(۶۰۳,۱۸۸)	(۳,۷۲۵,۳۶۳,۶۲۶,۶۷۵)	(۱,۰۸۴,۸۷۳,۰۴۶)	(۵,۸۹۱,۶۰۵,۴۳۰)	(۲,۳۳۹,۱۹۴,۱۷۸)	(۱۷,۲۳۶,۳۳۹,۹۶۷)	
معادل ریالی جمع بدهی های ارزی و تعهدات ارزی بانک -میلیون ریال	(۶۳۱,۸۱۱,۰۹۲)	(۳,۰۶۴,۷۳۰,۹۰۰)	(۳۲۵,۹۸۰)	(۱۶۱,۴۷۲)	(۶۶۱,۲۵۲,۸۰۵)	(۱۲۵,۰۹۳,۱۱۴)	(۷,۳۳۹,۶۰۶)	(۵۷,۳۶۵,۱۰۸)	(۶۱۰,۶۱۷,۲۶۵)	(۴۶,۳۲۰,۸۰۹)
خالص وضعیت باز ارزی مثبت (منفی) هر ارز در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹	۶۸,۸۵۸,۳۳۳	۴,۴۵۴,۳۹۲,۱۸۸	۲۷۳,۹۹۴	۱,۱۲۸,۴۶۹	۱۸۶,۷۴۸,۲۹۰,۸۶۴	۶۷۲,۰۵۸,۹۷۴	۵۰,۴۴۰,۷۰۴,۱۷۷	۴۳۶,۳۳۳,۶۵۸	۲,۲۰۸,۹۸۹,۱۱۵	
معادل ریالی خالص وضعیت باز هر ارز در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ - میلیون ریال	۹۰,۱۹۰,۰۲۶	۱,۱۶۲,۸۰۰,۹۰۹	۸۲,۵۴۶	۳۰۲,۰۸۸	۳۹,۰۸۸,۱۹۴	۱۰,۲۶۶,۲۲۰	۹,۴۵۹,۰۵۳	(۵۱,۵۴۲,۳۰۳)	۷۹,۳۳۳,۶۳۵	۱۲,۲۲۵,۷۵۳
درصد وضعیت باز هر ارز نسبت به سرمایه نظارتی در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ - درصد	%۰.۸۹	%۱۱۵.۲۸	%۰.۰۱	%۰.۰۳	%۳.۸۸	%۱.۰۲	%۰.۹۴	%(-۵.۱۱)	%۷.۸۷	%۱.۲۱
درصد وضعیت باز هر ارز نسبت به سرمایه نظارتی مبنای سایر نسبتهای احتیاطی در تاریخ ۱۴۰۱/۱۲/۲۹ - درصد	%۱.۹۰	%۲۴۴.۸۹	%۰.۰۲	%۰.۰۶	%۸.۲۳	%۲.۱۶	%۱.۹۹	%(-۱۰.۸۵)	%۱۶.۷۱	%۲.۵۷