

۹-۴- میزان ارقام در معرض ریسک بازار به تفکیک ارز، سهام، نرخ سود و نظایر آن

پایش حدود مقرر در دستورالعمل "وضعیت باز ارزی" - بخشنامه مب/ ۱۳۴۵ مورخ ۱۳۸۰/۱۲/۲۷ بانک مرکزی جمهوری اسلامی ایران.

جدول ۱ - خالص وضعیت باز ارزی در پایان دی ماه سال ۱۳۹۴

(ارقام به هزار ریال)						نوع ارز	شرح
جمع <sup>ه</sup> (معادل ریالی)	سایر اسعار	بن زاین	فرانک سوئیس	پوند	یورو	دلار	
							الف- ارقام دارایی و بدهی بانک
۵۰.۷۲۴.۷۹۹					۳,۰۰۵,۵۵۶	۴۷.۷۱۹.۲۴۳	الف-۱ لیست دارائیهای ارزی (بدون احتساب سرمایه پرداختی به شعب خارج کشور و حساب سهام و مشارکتهای خارجی) کسر می شود:
۵۰.۷۳۸.۰۳۴					۳,۰۰۷.۱۸۰	۴۷.۷۳۰.۸۵۴	الف-۲ لیست بدهیهای ارزی
							الف-۳ خالص دارائیهای ارزی (بدون احتساب سرمایه پرداختی به شعب خارج کشور و حساب سهام و مشارکتهای خارجی)
-۱۳.۲۲۵					-۱,۶۲۴	-۱۱,۶۱۱	(خالص ارقام بالای خط ترازنامه = مابه التفاوت "الف-۱" و "الف-۲")
							ب- حسابهای زیر خط ترازنامه
							ب-۱ تعهد مشتریان کسر می شود:
							ب-۲ تعهدات بانک
							ب-۳ خالص حسابهای زیر خط ترازنامه (مابه التفاوت "ب-۱" و "ب-۲")
							ج- خالص وضعیت باز ارزی بدون احتساب سرمایه پرداختی به شعب خارج کشور و حساب سهام و مشارکتهای خارجی
-۱۳.۲۲۵					-۱,۶۲۴	-۱۱,۶۱۱	(الف-۳ + ب-۳)
							د- حساب سرمایه پرداختی به شعب خارج کشور و حساب سهام و مشارکتهای خارجی
۴۰.۵۹.۴۸۸.۰۰۰					۴۰.۵۹.۴۸۸.۰۰۰	۴۰.۵۹.۴۸۸.۰۰۰	ه - پایه سرمایه بانک
$۳/۳ \times 10^{-۳}$					$۰/۴ \times 10^{-۳}$	$۲/۸ \times 10^{-۳}$	و- خالص وضعیت باز ارزی به پایه سرمایه بدون احتساب بند "د" فوق ("ج" تقسیم بر "ه")
۳۰٪					۱۰٪	۱۰٪	حودمجاز وضعیت باز (مطابق با بخشنامه مب/ ۱۳۴۵ مورخ ۱۳۸۰/۱۲/۲۷)
							ز- حساب سرمایه پرداختی به شعب خارج کشور و حساب سهام و مشارکتهای خارجی به پایه سرمایه ("د" تقسیم بر "ه")

\* ارقام مندرج در این جدول باید به ریال درج شود.





پایش حدود مقرر در دستورالعمل "تعيين نسبت تعهدات و بدهی های ارزی به دارایی های ارزی" طی بخشنامه شماره ۹۱/۲۴۳۱۱۰ مورخ ۱۳۹۱/۰۹/۱۴

دی ماه ۱۳۹۴													
ارقام به هزار ریال			ارقام به هزار واحد ارز										
معادل ریالی کل ارزها	معادل ریالی ارزش یورو	معادل ریالی ارزش دلار	ریال عربستان	دینار عراق	روبل روسیه	دلار استرالیا	دلار کانادا	درهم امارات	فرانک سوئیس	ین ژاپن	پوند	یورو	دلار
۲۹۰۵۴.۵۵۲	۲.۱۳۳.۸۶۸	۲۷.۸۰۰.۹۵۸										۶۵	۹۲۲
۲۹.۹۲۱.۵۹۱	۲.۱۳۲.۲۴۴	۲۷.۷۸۹.۳۴۷										۶۵	۹۲۱
۹۷%	۱۰۰%	۱۰۰%										۱۰۰%	۱۰۰%
۱۵۰%	۱۵۰%	۱۵۰%										۱۵۰%	۱۵۰%

۹۳/۰۹/۳۰	۹۲/۰۹/۳۰	۹۱/۰۹/۳۰	۹۰/۰۹/۳۰	شرح
(میلیون ریال)	(میلیون ریال)	(میلیون ریال)	(میلیون ریال)	
۴۵.۲۰%	۲۲.۶۱%	۳۰.۶۰%	۳.۸۵%	کل سرمایه گذاری بانک (شرکت های بورسی و غیر بورسی) به سرمایه پایه
۲۹.۴۸%	۹.۸۴%	۲۷.۵۷%	۱.۵۳%	سرمایه گذاری در شرکت های غیر بورسی به سرمایه پایه
۴.۳۱۵.۴۷۰	۵.۳۲۰.۱۰۴	۳۰.۲۳.۹۹۸	۲.۸۹۴.۳۰۳	سرمایه پایه
۶۷۸.۶۰۶	۶۷۹.۵۵۸	۹۱.۴۰۰	۶۶.۸۷۲	سرمایه گذاری در شرکت های بورسی
۱.۲۷۲.۱۷۳	۵۲۳.۵۰۴	۸۳۳.۸۰۸	۴۴.۴۲۱	سرمایه گذاری در شرکتهای غیر بورسی