

• **تعریف ریسک بازار**

ریسک بازار، به عنوان احتمال خطر مربوط به عدم قطعیت درآمدهای پرتفوی معاملاتی یک بانک به واسطه تغییر در شرایط بازار شامل قیمت دارایی، نرخ سود، نوسانات بازار و نقدینگی بازار تعریف می‌شود و زمانی به وجود می‌آید که موسسه مالی به طور فعالانه به خرید و فروش دارایی، بدهی و اوراق مشتقه مبادرت می‌نماید نه هنگامی که ارقام مذکور را برای مقاصد سرمایه گذاری بلندمدت، تامین مالی و مصون سازی نگهداری می‌کند.

• **واحدهای اجرایی مدیریت ریسک بازار**

واحدهای اجرایی مدیریت ریسک بازار شامل امور بین الملل، امور مالی و خزانه، امور سرمایه گذاری و دارایی های خارجی می باشد.

• **سیاست و رویه های مدیریت ریسک بازار**

با توجه به حجم پایین پرتفوی سرمایه گذاری های کوتاه مدت بانک که به قصد انتفاع خریداری شده اند تمهیدات و رویه های مذکور از سوی امور مالی صورت می پذیرد.

• **روش سنجش ریسک بازار**

بر اساس دستور العمل تیر ماه ۱۳۹۶ بانک مرکزی در خصوص "محاسبه سرمایه نظارتی و کفایت سرمایه موسسات اعتباری" معیار سنجش، سرمایه مورد نیاز پوشش آن ریسک در حوزه سهام و اوراق بهادار تجاری و نرخ ارز می باشد.

• **میزان سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار**

همانگونه که در روش سنجش ریسک بازار ذکر شد، میزان سرمایه پوششی ریسک بازار بر اساس جدول زیر می باشد:

سرمایه پوششی ریسک بازار (میلیون ریال)	ضریب ریسک (درصد)	دارایی (میلیون ریال)	ارقام دارایی (۱۳۹۷)
۳۵,۶۸۰	۸	۴۴۶,۰۰۵	سهام تجاری
۳,۸۲۶	۵	۷۶,۵۲۳	اوراق بهادار تجاری- ریسک خاص
۰	۰	۶۲,۲۸۴	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام - باقیمانده تا سررسید ۱ ماه و کمتر از آن
۸	۰,۴	۲,۰۹۲	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام - باقیمانده تا سررسید ۳ تا ۶ ماه
۸۵	۰,۷	۱۲,۱۴۷	اوراق بهادار تجاری- باقیمانده تا سررسید ۱ تا ۲ سال
۳,۷۹۸,۸۷۶	۸	۴۷,۴۸۵,۹۵۲	خالص دارایی/بدهی ارزی
۳,۸۳۸,۴۷۶			جمع سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار

- سرمایه گذاری در سهام سریع معامله در بازار به شرح یادداشت ۱-۱۲ و ۴-۱۲ به پیوست می باشد.

۱۳۹۷

(ارقام به میلیون ریال)

۱۳۹۶/۱۲/۲۹		۱۳۹۷/۱۲/۲۹				
خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	درصد سرمایه گذاری	نوع	منشاء ایجاد
						سرمایه گذاری جاری در سهام سریع معامله در بازار
						ابزار پوشش، اینگی و انارزگیری:
۱۵۱,۸۲۱	۶۹,۰۰۹	۲۸۰,۳۴۱	۱۲۷,۳۴۲	۳,۰۱	۶,۰۲۰,۱۵۷	خرید کنسورساز ایران
						استخراج گدازه های فلزی:
۳,۲۵۹	۲,۶۱۰	۴,۴۷۲	۳,۶۱۰	۰,۰۳	۸۸۲,۷۱۶	خرید توسعه معدنی و صنعتی صابور
۲۴,۲۷۶	۱۹,۷۱۴	۳۱,۴۴۶	۱۸,۹۴۵	۰,۲۶	۶,۲۸۹,۱۸۴	خرید توسعه معادن روی ایران
۳,۵۵۰	۳,۷۷۲	۷,۵۷۵	۳,۷۷۲	۰,۱۲	۲۲۸,۰۰۰	خرید معادن بافق
۳,۸۴۹	۳,۱۴۴	۱۰,۱۰۸	۳,۵۸۴	۰,۰۸	۸۴۰,۱۲۴	خرید یلدا
۶,۷۹۲	۴,۹۴۷	۱۱,۳۷۴	۴,۰۹۶	۰,۰۱	۲,۵۲۲,۴۱۲	خرید معدنی و صنعتی چادرملو
۰	۰	۳,۰۴۸	۲۹۱		۷۹۰,۶۰۷	خرید حق تقدم معدنی و صنعتی چادرملو
۲۴,۸۸۴	۲۴,۳۰۴	۷۴,۸۸۹	۲۵,۶۴۱	۰,۰۳	۹,۳۹۲,۷۹۶	خرید معدنی و صنعتی گل گهر
						انجمن سازی و املاک:
۰	۰	۵,۰۶۸	۵,۱۲۴	۰,۱۰	۵,۳۲۳,۶۳۰	خرید سرمایه گذاری مسکن
۰	۰	۱,۷۵۶	۱,۳۴۵	۰,۱۲	۱,۵۴۹,۴۴۹	خرید سرمایه گذاری مسکن تهران
۰	۰	۹۹۰	۹۹۸	۰,۰۴	۵۱۳,۸۶۹	خرید سرمایه گذاری مسکن پردیس
۰	۰	۲۵۹	۲۶۰	۰,۰۳	۲۴۸,۹۰۰	خرید آس پ
						بانکها و موسسات اعتباری:
۳۰,۶۲۷	۱۴,۳۱۲	۲۹,۸۵۵	۱۴,۳۱۲	۰,۱۴	۱۴,۳۱۱,۸۵۲	خرید بانک نصاب
۱,۴۰۴	۱,۴۲۹	۰	۰	۰	۰	خرید بانک دی
						فهرده و ساخت قطعات:
۵,۶۷۹	۸,۸۴۲	۲,۴۶۲	۲,۹۹۲	۰,۰۱	۲,۲۵۰,۰۰۰	خرید سایپا
۱۶۰	۱۸۷	۱۷۳	۱۸۷	۰	۲۰۰,۰۰۰	خرید زمیناد
۲۰۱	۲۱۲	۱۵۹	۲۱۲	۰,۰۱	۵۰۰,۰۰۰	خرید پهمن دتیل
۱,۱۸۳	۱,۶۰۲	۱,۳۷۴	۱,۶۰۲	۰,۰۲	۱,۷۵۹,۶۳۰	خرید سرمایه گذاری رنا

(ارقام به میلیون ریال)

۱۳۹۶/۱۲/۲۹		۱۳۹۷/۱۲/۲۹				
خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	خالص ارزش فروش	بهای تمام شده	درصد سرمایه گذاری	تعداد	منشاء ایجاد
۰	۰	۲۸۱	۴۸۸	۰,۰۰	۱۰۰,۰۰۰	فولاد کاهه جنوب کیش خرید
۰	۰	۱۲۴	۵۷	۰,۰۰	۵۷,۱۴۲	حق تقدم فولاد کاهه جنوب کیش خرید
۰	۰	۲,۴۵۰	۲,۰۲۵	۰,۰۰	۶۴۲,۱۲۲	ملی صنایع مس ایران خرید
						مصولات نسبیایی:
۱,۰۴۶	۸۶۶	۲,۵۲۳	۲,۶۶۱	۰,۰۰	۱,۵۵۹,۰۰۰	سرمایه گذاری نفت و گاز و پتروشیمی تأمین خرید
۰	۰	۱۱	۱۲	۰,۰۰	۲۹۸	پتروشیمی پارس خرید
۴۴,۲۷۲	۲۵,۴۱۵	۵,۱۹۱	۳,۷۹۲	۰,۰۰	۸۴,۶۱۹	پتروشیمی زاگرس خرید
۱۰,۹۵۲	۶,۸۱۶	۲,۴۵۱	۸۲۵	۰,۰۰	۴۴,۷۸۸	پتروشیمی فن آوران خرید
۱۵,۴۵۰	۸,۷۲۸	۶,۹۷۱	۴,۹۴۲	۰,۰۱	۱۵۶,۴۶۸	پتروشیمی خارک خرید
۷۲۴	۵۵۶	۰	۰	۰	۰	پتروشیمی خراسان خرید
۲۱,۷۷۶	۱۸,۲۹۹	۲۰,۰۴۲	۹,۷۷۵	۰,۰۱	۵۵۰,۱۷۰	پتروشیمی مارون خرید
۸,۴۵۲	۶,۸۳۰	۲,۹۷۲	۲,۰۸۰	۰,۰۰	۲۱۷,۳۶۰	پتروشیمی پردیس خرید
۵۰۹	۴۲۹	۰	۰	۰	۰	پتروشیمی شیراز خرید
۹۹۲	۷۰۵	۶۹۲	۴۲۷	۰,۰۰	۱۰۴,۷۸۲	پتروشیمی کرمانشاه خرید
۰	۰	۵,۴۵۱	۵,۹۲۷	۰,۰۰	۱,۲۸۱,۰۰۰	صنایع پتروشیمی خلیج فارس خرید
۰	۰	۷۸۵	۱,۰۴۷	۰,۰۰	۲۰۰,۰۰۰	گسترش نفت و گاز پارسین خرید
۵۴۹,۰۴۷	۳۵۷,۹۹۵	۸۲۷,۰۹۲	۴۴۶,۰۰۵			جمع سرمایه گذاری های جاری
						سرمایه گذاری بلندمدت در سهام سریع معامله در بازار
						فعالیت های کمکی به نهادهای مالی واسطه:
۴۹,۲۰۰	۶,۵۲۲	۶۱,۹۵۹	۶,۵۲۲	۱۶,۸۷	۶,۵۲۲,۰۰۰	تهاد های مالی بورس انرژی خرید
۲۲۷	۱۰	۴۱۲	۱۰	۰,۰۱	۷۰,۰۰۰	فربورس ایران خرید
						خدمات فنی و مهندسی:
۳,۷۷۸,۶۴۰	۴,۱۹۲,۱۹۵	۵,۸۸۷,۸۰۶	۴,۱۹۲,۱۹۵	۵,۵۶	۱,۵۰۱,۲۲۵,۴۵۸	مدیریت پروژه های نیروگاهی ایران (گروه مهنا) خرید
۳,۸۲۸,۱۶۷	۴,۱۹۸,۷۲۷	۵,۹۵۰,۱۷۷	۴,۱۹۸,۷۲۷			جمع سرمایه گذاری های بلندمدت
۴,۳۷۷,۲۱۴	۴,۵۵۶,۷۲۲	۶,۷۷۷,۲۶۹	۴,۶۴۴,۷۳۲			جمع سرمایه گذاری در سهام سریع معامله در بازار

۱۳۹۶/۱۲/۲۹	۱۳۹۷/۱۲/۲۹				
میلیون ریال	میلیون ریال	فرخ سود	نوع اوراق	منشاء ایجاد	فاشتر
۱۹,۵۵۹	-	-	-	خرید	مشارکت اجاره هواپیمایی ملغان ۹۹۰۳
-	۱۰,۳۹۵	-	-	خرید	اسناد خزانه- م ۳ بودجه ۹۶- ۹۷۰۷۱۰
-	۴,۲۸۶	-	-	خرید	اسناد خزانه- م ۴ بودجه ۹۶- ۹۸۰۸۲۰
-	۵۱,۸۸۹	-	-	خرید	اسناد خزانه- م ۵ بودجه ۹۶- ۹۷۰۹۲۶
-	۲۱۷	-	-	خرید	اسناد خزانه- م ۶ بودجه ۹۶- ۹۸۰۲۲۲
-	۲,۰۹۲	-	-	خرید	اسناد خزانه- م ۹ بودجه ۹۶- ۹۸۰۴۱۱
-	۷,۲۲۶	-	-	خرید	اسناد خزانه- م ۱۲ بودجه ۹۶- ۹۸۱۱۱۴
-	۴۱۷	-	-	خرید	اسناد خزانه- م ۱۴ بودجه ۹۶- ۹۸۱۰۱۶
۱۹,۵۵۹	۷۶,۵۲۳				