



ردیف	سرفصل اطلاعات	انتشار
۱	سیاست‌ها و رویه‌های مدیریت ریسک بازار	مهمترین شاخص های ریسک بازار، ریسک نوسانات نرخ ارز و ریسک نوسانات نرخ سود است. سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار طبق دستورالعمل ابلاغی بانک مرکزی ج.ا.ا. برای نرخ ارز و اوراق بهادار تجاری محاسبه میشود. سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار نرخ ارز با احتساب وضعیت باز مثبت یا قدر مطلق وضعیت باز منفی تمام ارزها هر کدام که بیشتر باشد محاسبه میشود. همچنین با توجه به اینکه اسناد خزانه اسلامی در پرتفوی داراییهای بانک وجود دارد، ریسک خاص (۵٪ مجموع بهای تمام شده اوراق بهادار تجاری) و ریسک عام (با توجه به مانده اوراق و مدت زمان باقی مانده تا سررسید) محاسبه میشود. برای مدیریت بهینه ریسک بازار مانده اوراق اسناد خزانه، نرخ اوراق و سررسید آن پایش می شود.
۲	روش سنجش ریسک بازار	روش شبیه سازی گذشته نگر یا تاریخی است که ابتدا اجزای پرتفوی بانک تعیین و ارزش پرتفوی مذکور براساس قیمت های بازار درروز گذشته محاسبه می شود.
۳	میزان سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار	۷۸۲،۰۵۱،۵۰۰،۵۱۸
۴	میزان ارقام در معرض ریسک بازار به تفکیک ارز، سهام، نرخ سود و نظایر آن	بانک فاقد سرمایه گذاری در سهام میباشد، مهمترین شاخصهای ریسک بازار، مانده وضعیت ارزی، نرخ سود سپرده ارزی، تغییرات نرخ ارز، مانده اوراق بهادار میباشد.