

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 و نوسانات قیمت سهام 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	برای سنجش معیارهای ارزیابی ریسک بازار بانک مشترک از روش‌های ریسک‌سنجی، مونت کارلو و شبیه سازی تاریخی استفاده می‌شود.
۳	میزان سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار (میلیون ریال)	۱,۶۰۲,۵۵۰
۴	میزان ارقام در معرض ریسک بازار به تفکیک ارز، سهام، نرخ سود و نظایر آن	مهمترین ارقام در معرض ریسک بازار، مانده وضعیت ارزی با توجه به نوسانات نرخ بهره ارزی و نوسانات نرخ ارز و تغییر ارزش سرمایه‌گذاری در اوراق بهادار (سهام و اوراق با درآمد ثابت) با توجه به نوسانات سهام و نرخ بدهی می باشد. ارزش در معرض ریسک پرتفولیو سهام به روش ریسک سنجی ۱۳,۴۸۲,۵۹۱,۹۲۰ ریال و ارزش در معرض ریسک پرتفولیو اوراق درآمد ثابت به روش ریسک سنجی ۱,۷۸۰,۳۲۵,۷۳۰ ریال و ارزش در معرض ریسک وضعیت ارزی به روش شبیه سازی تاریخی ۱,۵۳۲,۱۴۴,۷۴۶,۲۵۹ ریال است.