

جدول بند ۱۵ - ۱ - ۱۳ : وضعیت کفایت سرمایه شامل : میزان دارایی های در معرض ریسک، میزان و ساختار سرمایه ،

نسبت کفایت سرمایه و نسبت کفایت سرمایه درجه یک - به شرح مندرج در بخش سوم (ماده ۱۱)

۲-۷-۵۴- جمع دارایی های موزون شده به ریسک بازار در پایان سال مالی منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹ مبلغ ۷,۳۹۲,۱۵۹ میلیون ریال می باشد.

۱۳۹۷			۱۳۹۸			شرح
میزان سرمایه لازم	ضریب ریسک	مبلغ	میزان سرمایه لازم	ضریب ریسک	مبلغ	
میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	
۱۸۵,۰۲۶	۸.۰۰	۲,۳۱۲,۸۳۱	۱۸۵,۰۲۶	۸.۰۰	۲,۳۱۲,۸۳۱	سهام تجاری
۳۵,۰۶۴	۵.۰۰	۷۰۱,۲۸۹	۲۴۸,۴۳۰	۵.۰۰	۴,۹۶۸,۵۹۴	مجموع بهای تمام شده اوراق بهادار تجاری- ریسک خاص
.	۰.۰۰	.	.	۰.۰۰	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید یک ماه و کمتر از آن
.	۰.۲۰	.	.	۰.۲۰	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۱ تا ۳ ماه
.	۰.۴۰	.	.	۰.۴۰	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۳ تا ۶ ماه
۳,۵۸۲	۰.۷۰	۵۱۱,۷۵۱	.	۰.۷۰	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۶ تا ۱۲ ماه
۲,۳۶۹	۱.۲۵	۱۸۹,۵۳۸	۴,۴۴۰	۱.۲۵	۳۵۵,۲۱۵	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۱ تا ۲ سال
.	۱.۷۵	.	۴۵,۷۳۴	۱.۷۵	۲,۶۱۳,۳۷۹	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۲ تا ۳ سال
.	۲.۲۵	.	۴۵,۰۰۰	۲.۲۵	۲,۰۰۰,۰۰۰	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۳ تا ۴ سال
.	۲.۷۵	.	.	۲.۷۵	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۴ تا ۵ سال
.	۳.۲۵	.	.	۳.۲۵	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۵ تا ۷ سال
.	۳.۷۵	.	.	۳.۷۵	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۷ تا ۱۰ سال
.	۴.۵۰	.	.	۴.۵۰	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۱۰ تا ۱۵ سال
.	۵.۲۵	.	.	۵.۲۵	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۱۵ تا ۲۰ سال
.	۶.۰۰	.	.	۶.۰۰	.	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید بیش از ۲۰ سال
۴۸,۲۵۷	۸.۰۰	۶۰۳,۲۱۵	۶۲,۷۴۲	۸.۰۰	۷۸۴,۲۷۷	وضعیت باز مثبت تمامی ارزشها یا قدر مطلق وضعیت باز منفی تمامی ارزشها هر کدام که بیشتر است
۲۷۴,۳۰۰			۵۹۱,۳۷۳			جمع سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار
۱۲.۵			۱۲.۵			ضریب
۳,۴۲۸,۷۴۵			۷,۳۹۲,۱۵۹			دارایی موزون شده به ریسک بازار

۲-۷-۵۴- جمع دارایی های موزون شده به ریسک عملیاتی در پایان دوره مالی منتهی به ۱۳۹۸/۱۲/۲۹ مبلغ ۱۶,۷۸۱,۶۱۶ میلیون ریال می باشد.

۱۳۹۷	۱۳۹۸	
------	------	--

شرح	مبلغ	ضریب ریسک	میزان سرمایه لازم برای پوشش ریسک عملیاتی	مبلغ	ضریب ریسک	میزان سرمایه لازم برای پوشش ریسک عملیاتی
	میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	میلیون ریال
میانگین مجموع درآمدهای سه سال اخیر بانک	۸,۹۵۰,۱۹۵	۱۵	۱,۳۴۲,۵۲۹	۱۵	۶,۹۴۹,۳۵۰	۱,۰۴۲,۴۰۳
ضریب			۱۲.۵			۱۲.۵
دارایی موزون شده به ریسک عملیاتی			۱۶,۷۸۱,۶۱۶			۱۳,۰۳۰,۰۳۱