

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)

۲-۷-۵۵- جمع دارایی های موزون شده به ریسک بازار در پایان سال مالی منتهی به ۱۳۹۹/۱۲/۳۰ مبلغ ۱,۳۷۹,۸۶۵ میلیون ریال می باشد.

۱۳۹۸			۱۳۹۹			شرح
میزان سرمایه لازم	ضریب ریسک	مبلغ	میزان سرمایه لازم	ضریب ریسک	مبلغ	
میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	
۱۶۸,۲۳۵	۸/۱۰۰	۲,۱۰۲,۹۳۴	۲۳۱	۸/۱۰۰	۲,۸۹۳	سهام تجاری
•	۵/۱۰۰	•	•	۵/۱۰۰	•	مجموع بهای تمام شده اوراق بهادار تجاری- ریسک خاص
•	۰/۱۰۰	•	•	۰/۱۰۰	•	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 ۳ تا ۱ ماه
•	۰/۴۰	•	•	۰/۴۰	•	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۳ تا ۳ ماه
•	۰/۷۰	•	•	۰/۷۰	•	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۶ تا ۱۲ ماه
•	۱/۲۵	•	•	۱/۲۵	•	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۱ تا ۲ سال
•	۱/۷۵	•	•	۱/۷۵	•	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید ۲ تا ۳ سال
•	۲/۲۵	•	•	۲/۲۵	•	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
•	۶/۱۰۰	•	•	۶/۱۰۰	•	اوراق بهادار تجاری- ریسک عام -مدت زمان باقی مانده تا سررسید بیش از ۲۰ سال
۶۲,۷۴۲	۸/۱۰۰	۷۸۴,۲۷۷	۱۱۰,۱۵۸	۸/۱۰۰	۱,۳۷۶,۹۷۲	وضعیت باز مثبت تمامی ارزشها یا قدر مطلق وضعیت باز منفی تمامی ارزشها هر کدام که بیشتر است
۲۳۰,۹۷۷			۱۱۰,۲۸۹			جمع سرمایه مورد نیاز برای پوشش ریسک بازار
۱۲/۵			۱۲/۵			ضریب
۲,۸۸۷,۳۱۱			۱,۳۷۹,۸۶۵			دارایی موزون شده به ریسک بازار

۲-۷-۵۵- جمع دارایی های موزون شده به ریسک عملیاتی در پایان دوره مالی منتهی به ۱۳۹۹ مبلغ ۲۶,۳۶۷,۲۸۸ میلیون ریال می باشد.

۱۳۹۸			۱۳۹۹			شرح
میزان سرمایه لازم برای پوشش ریسک عملیاتی	ضریب ریسک	مبلغ	میزان سرمایه لازم برای پوشش ریسک عملیاتی	ضریب ریسک	مبلغ	
میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	میلیون ریال	درصد	میلیون ریال	
۱,۳۴۲,۵۲۹	۱۵	۸,۹۵۰,۱۹۵	۲,۱۰۹,۳۸۳	۱۵	۱۴,۰۶۲,۵۵۳	میانگین مجموع درآمدهای سه سال اخیر بانک
	۱۲/۵			۱۲/۵		ضریب
۱۶,۷۸۱,۶۱۶			۲۶,۳۶۷,۲۸۸			دارایی موزون شده به ریسک عملیاتی