

## ۹-۴- میزان ارقام در معرض ریسک بازار به تفکیک ارز، سهام، نرخ سود

مطابق محاسبات صورت گرفته با عنایت به پیش بینی درصد تغییر نرخ ارز مبادله‌ای و برابری ارزشها، میزان سود یا زیان

بانک به تفکیک ارزشهای موجود در پورتفوی ارزی در سال جاری مطابق جدول ذیل می‌باشد:

نوع ارز	۱۳۹۶/۱۲/۲۹		۱۳۹۵/۱۲/۳۰	
	تغییر احتمالی در قیمت بازار	سطح بالا و پایین تاثیر در سود و زیان	تغییر احتمالی در قیمت بازار	سطح بالا و پایین تاثیر در سود و زیان
دلار آمریکا	درصد (۱۸ و ۱۴)	میلیون ریال ۷۵۲.۰۸۵ الی ۹۶۶.۹۶۷	درصد (۱۰ و ۶)	میلیون ریال ۲۸۵.۶۶۷ الی ۴۷۶.۱۱۲
یورو	(۳۰ و ۳۴)	۶۷.۹۴۶.۳۸۵ الی ۶۳.۹۴۹.۵۳۹	(۱ و ۵)	۶.۰۴۵.۳۰۲ الی ۱.۲۰۹.۰۶۰
وون کره	(۲۰ و ۲۴)	۱.۳۹۰.۶۶۹ الی ۱.۶۶۸.۸۰۳	(۴ و ۹)	۳۳۲.۶۵۲ الی ۷۴۸.۴۶۸
لیبر ترکیه	(۵ و ۹)	۱۰۸.۱۴۲ الی ۱۹۴.۶۵۷	(-۲ و -۵)	-۵۵.۱۹۹ الی -۲۲.۰۷۹
ین ژاپن	(۲۱ و ۲۵)	۵۰۸.۷۸۳ الی ۶۰۵.۶۹۴	(-۳ و ۸)	-۴۸.۵۳۸ الی ۱۲۹.۴۳۶
درهم امارات	(۱۴ و ۱۸)	۲.۱۶۸.۹۹۹ الی ۲.۷۸۸.۷۱۳	(۶ و ۱۰)	۱.۱۳۳.۲۵۶ الی ۱.۸۸۸.۷۶۱

با توجه به پیش بینی درصد تغییرات قیمت بازار سهام موجود در پورتفوی سهام بانک ملت، میزان سود پیش بینی شده

ناشی از تغییرات قیمت سهام، برای سال جاری مطابق جدول ذیل می‌باشد:

نوع سرمایه‌گذاری	۱۳۹۶/۱۲/۲۹			۱۳۹۵/۱۲/۳۰		
	مبلغ	تغییر احتمالی در قیمت بازار	تاثیر در سود و زیان	مبلغ	تغییر احتمالی در قیمت بازار	تاثیر در سود و زیان
اوراق بهادار ارزی	میلیون ریال ۱,۲۹۰,۳۴۷	(-۲ و ۰)	(۱۲,۹۰۳)	میلیون ریال ۱,۶۶۹,۳۶۳	(-۲ و ۰)	(۱۶,۶۹۳)
اوراق مشارکت بخش دولتی	۴۷,۶۴۰,۴۲۰	(-۱/۵ و ۰)	(۳۵۷,۳۰۳)	۳۵,۷۵۵,۶۸۰	(-۲ و ۰)	(۳۵۷,۵۵۶)
اوراق مشارکت بخش غیر دولتی	۲,۰۱۴,۷۵۷	(-۳ و ۰)	(۳۰,۲۲۱)	۱,۹۴۲,۲۰۳	(-۲ و ۰)	(۱۹,۴۲۲)
اوراق بهادار دولتی شعب خارج از کشور	۲,۳۴۴,۳۶۱	(-۲ و ۰)	(۲۳,۴۴۴)	۷۰۹,۷۱۳	(-۲ و ۰)	(۷,۰۹۷)
اوراق بهادار خصوصی شعب خارج از کشور	۱,۱۷۴,۰۳۴	(-۲ و ۰)	(۱۱,۷۴۰)	۱,۳۳۵,۴۵۴	(-۲ و ۰)	(۱۳,۳۵۴)
جمع	۵۴,۴۶۳,۹۱۹	.....	(۴۳۵,۶۱۱)	۴۱,۴۱۲,۴۱۳	---	(۴۱۴,۱۲۲)

