

**بانک ملت (سهامی عام)**  
**یادداشت‌های توضیحی صورتهای مالی میان دوره ای**  
**دوره شش ماهه منتهی به ۳۱ شهریور ۱۴۰۱**

**۵-۵-۵- تحلیل ارزش در معرض خطر نرخ ارز**

وضعیت داراییها و بدهیها و تعهدات ارزی در پایان ۱۴۰۱/۶/۳۱ به شرح زیر است:

یادداشت	دلار آمریکا	ایزو	پوند انگلیس	لوانگ سوئیس	ون کز	لیر ترکیه	ین ژاپن	دزهم امارات	یوان چین	سایر ارزها
۲۶	۳۱۴,۵۹۳,۷۵۶	۸۴۶,۶۶۸,۴۸۸	۱,۲۱۲	۱,۱۷۱,۹۲۴	۴۴,۱۰۶,۸۱۶,۰۲۶	۱,۱۲۴,۳۵۷,۰۲۲	۱,۲۲۴,۴۶۵,۷۰۲	۱,۵۲۴,۸۱۵,۹۲۱	۹۶,۳۶۸,۶۷۱	
۲۷	۶,۹۰۸,۶۱۳	۶۷۲,۴۴۱,۸۴۵	۱,۴۰۲,۹۲۸	۱۸	۳,۶۴۴,۳۹۵,۴۰۲,۹۲۴	۳۳,۰۸۲,۳۰۹	۷,۴۹۵,۴۱۴,۷۱۳	۱,۶۹۴,۷۳۳,۱۴۷	۲,۲۴۰,۴۲۱,۱۴۰	
۲۹	۱,۱۴۶,۹۵۵,۴۱۸	۱۲,۳۳۳,۲۰۷,۲۸۱	-	-	-	-	۷۹۲,۹۸۳,۶۶۶	۲۲,۳۱۶,۵۳۴	۷,۲۶۵,۹۶۶,۰۴۵	
۳۰	۳۰,۶۱۱,۴۹۸	۹۸۹,۹۰۵,۵۲۸۲	(۵۷,۸۵۶)	۵۵۹,۷۱۲	۲۲۲,۸۹۴,۲۴۱,۹۶۷	۲۶۴,۱۲۸,۶۰۶	۱,۲۸۷,۴۹۳,۱۲۷	۳۰۸,۰۹۰,۰۹۳	۳۶۷,۷۶۲,۴۵۲	
۳۳	-	-	-	-	-	۷,۱۳۹,۹۰۰	-	-	-	
۳۱	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
۳۲	۴,۳۹۵,۵۰۸	۲۴,۷۰۷,۲۲۰	۴,۶۵۲	-	۳۳۸,۰۹۳,۲۸۸	۱۵,۲۳۸,۵۷۷	۴,۷۱۶,۵۸۷	-	-	
۳۷	-	-	-	-	-	۳۱۷,۶۹۹,۶۰۰	-	-	-	
۳۸	۸,۳۸۸,۳۰۰	۱۹,۳۴۶,۰۰۹	۱۸۴,۱۰۸	۱,۴۱۱,۵۲۷	۱۰۱,۲۷۸,۴۴۳,۳۷۲	(۴۰,۹۳۳,۷۷۹)	۱۱۲,۶۶۶,۰۸۲	۸,۷۴۲,۶۹۹	۶,۲۷۶,۰۹۹,۱۱۰	
جمع داراییهای ارزی	۱,۵۰۱,۸۵۲,۹۴۲	۱۴,۸۷۷,۳۶۶,۵۲۵	۱,۵۲۷,۰۲۶	۳,۱۴۳,۱۸۴	۴,۰۱۲,۲۰۷,۷۱۳,۵۷۶	۱,۲۱۷,۶۰۲,۱۴۵	۱۱,۰۱۶,۷۳۱,۸۶۶	۳,۶۲۸,۷۱۸,۳۹۳	۱۶,۳۴۶,۵۲۷,۴۱۸	
۵۵-۱	۳,۸۴۶,۹۲۷	۹۵۵,۰۶۱,۱۴۷	-	-	-	۱,۹۳۵,۷۸۵	۱۹,۸۴۰,۶۲۵	۴۱,۵۲۴	۲,۹۲۰,۹۲۳,۲۰۰	
۵۵-۲	۵۵,۹۳۹,۳۶۱	۶۲۲,۴۰۶,۶۸۵	۱,۸۴۰	-	-	۹,۹۲۷,۶۴۹	-	۵۸,۲۱۰,۰۹۶	۲۱۲,۱۵۳,۴۱۶	
۵۵-۳	۹۳۹,۴۴۳,۴۷۸	۵۲۱,۱۳۹,۳۲۲	-	-	-	۱۱,۸۷۳,۲۳۴	۱۹,۸۴۰,۶۲۵	۵,۸۶۲,۶۲۰	۱۶۶,۳۴۰,۸۹۰	
جمع تعهدات ارزی مشتریان	۹۹۹,۲۱۹,۶۶۵	۳,۱۰۸,۶۰۷,۰۵۴	۱,۸۴۰	-	-	۱۲,۲۱۹,۴۷۹,۵۷۹	۱۱,۰۳۶,۵۸۰,۴۹۱	۳,۶۳۴,۵۸۱,۰۱۲	۱۹,۶۵۵,۸۵۴,۹۲۴	
جمع داراییهای ارزی و تعهدات ارزی مشتریان	۳,۵۰۱,۰۷۲,۶۰۸	۱۶,۹۸۵,۹۷۳,۵۷۹	۱,۵۲۸,۸۸۶	۳,۱۴۳,۱۸۴	۴,۰۱۲,۲۰۷,۷۱۳,۵۷۶	۱,۲۲۹,۴۷۵,۵۷۹	۱۱,۰۳۶,۵۸۰,۴۹۱	۳,۶۳۴,۵۸۱,۰۱۲	۱۹,۶۵۵,۸۵۴,۹۲۴	
معادل ریالی جمع داراییهای ارزی و تعهدات ارزی مشتریان میلیون ریال	۴۹۱,۴۱۹,۹۲۹	۲,۶۲۷,۵۵۳,۷۹۸	۳۶۵,۰۲۹	۴۲۹,۰۵۴	۶۲۵,۲۰۱,۸۶۳	۱۶,۲۲۷,۳۹۶	۱۵,۱۰۵,۲۰۹	۳۳,۵۹۲,۴۴۴	۶۰۸,۴۲۷,۵۲۷	۵۱,۴۶۰,۳۱۱
۴۰	(۲۰,۷۷۱,۹۲۸)	(۳,۲۰۷,۴۴۱,۰۷۱)	(۷۷۶,۴۲۲)	(۲۱,۴۲۰)	(۳,۱۱۶,۹۴۱,۰۴۲)	(۹۴,۰۷۲,۶۸۰)	(۱۰۶,۰۵۵,۶۸۲)	(۱۵۹,۶۲۱,۶۸۹)	(۴۲۱,۲۴۹,۶۲۷)	
۳۹	(۱۱۶,۹۴۴,۱۰۱)	(۶۲۴,۵۰۳,۲۲۹)	(۱۶۷,۶۸۴)	(۵۸۱,۰۴۷)	(۳,۳۶۹,۵۸۲,۲۳۹,۰۸۰)	(۲۹۰,۵۲۶,۲۷۲)	(۳,۶۹۸,۶۲۳,۵۱۸)	(۹۸۵,۵۷۹,۴۷۴)	(۴۱۰,۰۵۹,۶۴۰)	
۴۳	(۹۲۶,۱۶۰,۳۶۹)	(۵,۱۴۵,۹۱۳,۳۲۰)	(۱۳۶,۸۲۲)	(۷۲۱)	(۴۱۰,۵۱۶,۶۵۷,۷۸۸)	(۷۴,۴۶۶,۶۰۹)	(۳,۰۸۵,۱۸۴,۳۶۷)	(۱,۸۰۲,۵۴۸,۱۲۰)	(۱۲,۳۴۶,۸۰۱,۷۰۳)	
حقوق صاحبان سپردههای سرمایه گذاری	(۳۹۰,۹۷۲,۴۵۰)	(۱,۱۶۵,۲۱۱,۴۱۰)	-	-	(۷۱۰,۸۱۰,۰۱۶)	(۸۷,۲۰۵)	(۹,۸۱۶,۹۸۵)	(۲۰۷,۲۸۰,۰۰۳)	-	
جمع بدهیهای ارزی	(۱,۴۵۴,۸۶۸,۹۴۷)	(۱۰,۳۱۳,۰۲۹,۰۳۰)	(۱,۰۸۰,۳۲۷)	(۶۰۳,۱۸۸)	(۳,۷۸۲,۲۲۳,۹۶۶,۰۱۶)	(۴۵۹,۱۵۲,۵۶۷)	(۵,۸۹۹,۶۸۰,۵۵۲)	(۳,۱۵۵,۰۳۱,۳۸۶)	(۱۴,۳۳۹,۱۱۰,۹۸۰)	
۵۵-۱	(۳,۸۴۶,۹۲۷)	(۹۵۵,۰۶۱,۱۴۷)	-	-	-	(۱,۹۳۵,۷۸۵)	(۱۹,۸۴۰,۶۲۵)	(۴۱,۵۲۴)	(۲,۹۲۰,۹۲۳,۲۰۰)	
۵۵-۲	(۵۵,۹۳۹,۳۶۱)	(۶۲۲,۴۰۶,۶۸۵)	(۱,۸۴۰)	-	-	(۹,۹۲۷,۶۴۹)	-	(۵۸,۲۱۰,۰۹۶)	(۲۱۲,۱۵۳,۴۱۶)	
۵۵-۳	(۹۳۹,۴۴۳,۴۷۸)	(۵۲۱,۱۳۹,۳۲۲)	-	-	-	(۱۱,۸۷۳,۲۳۴)	(۱۹,۸۴۰,۶۲۵)	(۵,۸۶۲,۶۲۰)	(۱۶۶,۳۴۰,۸۹۰)	
جمع تعهدات ارزی بانک	(۹۹۹,۲۱۹,۶۶۵)	(۳,۱۰۸,۶۰۷,۰۵۴)	(۱,۸۴۰)	-	-	(۱۲,۲۱۹,۴۷۹,۵۷۹)	(۱۱,۰۳۶,۵۸۰,۴۹۱)	(۳,۶۳۴,۵۸۱,۰۱۲)	(۱۹,۶۵۵,۸۵۴,۹۲۴)	
جمع بدهیهای ارزی و تعهدات ارزی بانک	(۳,۵۰۱,۰۷۲,۶۰۸)	(۱۶,۹۸۵,۹۷۳,۵۷۹)	(۱,۵۲۸,۸۸۶)	(۳,۱۴۳,۱۸۴)	(۴,۰۱۲,۲۰۷,۷۱۳,۵۷۶)	(۱,۲۲۹,۴۷۵,۵۷۹)	(۱۱,۰۳۶,۵۸۰,۴۹۱)	(۳,۶۳۴,۵۸۱,۰۱۲)	(۱۹,۶۵۵,۸۵۴,۹۲۴)	
معادل ریالی جمع بدهیهای ارزی و تعهدات ارزی بانک میلیون ریال	۴۹۱,۴۱۹,۹۲۹	۲,۶۲۷,۵۵۳,۷۹۸	۳۶۵,۰۲۹	۴۲۹,۰۵۴	۶۲۵,۲۰۱,۸۶۳	۱۶,۲۲۷,۳۹۶	۱۵,۱۰۵,۲۰۹	۳۳,۵۹۲,۴۴۴	۶۰۸,۴۲۷,۵۲۷	
خالص وضعیت باز ارزی مثبت (منفی) هر روز در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱	۵,۱۹۴,۹۱۷	۴,۵۴۴,۳۱۷,۴۹۵	۲۵۶,۱۱۹	۳۰۰,۴۴۴	۳۲,۹۶۲,۲۱۴	۱۰,۱۸۸,۰۰۲	۸,۴۴۲,۰۹۱	۸,۰۶۲,۰۹۱	۲,۱۱۷,۴۱۶,۴۲۷	۱۱,۱۲۹,۱۳۰
معادل ریالی خالص وضعیت باز هر روز در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ - میلیون ریال	۵,۱۹۴,۹۱۷	۴,۵۴۴,۳۱۷,۴۹۵	۲۵۶,۱۱۹	۳۰۰,۴۴۴	۳۲,۹۶۲,۲۱۴	۱۰,۱۸۸,۰۰۲	۸,۴۴۲,۰۹۱	۸,۰۶۲,۰۹۱	۲,۱۱۷,۴۱۶,۴۲۷	۱۱,۱۲۹,۱۳۰
درصد وضعیت باز هر روز نسبت به سرمایه نظارتی در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ - درصد	۰.۷۴	۰.۰۷	۰.۰۱	۰.۰۴	۰.۶۸	۰.۳۵	۰.۱۲	۰.۴۹	۰.۴۰	۱.۵۸
درصد وضعیت باز هر روز نسبت به سرمایه نظارتی معای سایر سفتهای استهلاکی در تاریخ ۱۴۰۱/۰۶/۳۱ - درصد	۰.۰۹	۰.۰۷	۰.۰۲	۰.۰۶	۰.۶۴	۰.۱۵	۰.۷۸	۰.۶۰	۰.۴۶	۰.۳۴