بانک توسعه صادرات ایران

یادداشتهای توضیحی صورتهای مالی

سال مالی منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

۵-۵-۶۲-تحلیل ارزش در معرض خطر نرخ ارز

وضعیت ارزی بانک در پایان اسفند ماه سال ۱۳۹۸ به شرح زیر است :

	شماره یادداشت	پوند انگلیس	دلار کانادا	یورو	دلار استرالیا	درهم امارات	فرانک سوئیس	دلارآمریکا	یوان چین	یکصد ین ژاپن	روپیه هند	یک هزار وون کره جنوبی	لیرترکیه	ریال قطر
موجودی نقد	۹	۸۳,۵۳۰	۹۴۳	۳۹۱,۷۷۱,۹۹۱	۶۰۰	۴۱,۵۵۹,۰۰۸	۳۵,۸۹۴	۶۲,۶۷۴,۷۱۶	۲۲۸,۷۷۴,۶۰۰	۲,۹۱۱,۷۲۲	۳۹۵,۷۶۲,۴۷۲	۳۳۸,۸۳۰,۳۱۰	۸۰۱,۸۵۵	۰
مطالبات از بانکها و سایر موسسات اعتباری	۱۰	۷,۳۴۴	۰	۲۳۰,۵۴۳,۵۶۰	۴۴۱	۳۳,۶۲۱,۶۸۱	۳۱,۰۲۰	۳۱,۳۸۲,۹۴۰	۲۴۶,۳۸۰,۹۶۰	۱۱,۹۲۰,۶۰۲	۱,۲۸۱,۱۲۴,۶۶۰	۲۱,۸۶۹,۵۳۷,۸۲۷	۲۴	۱,۵۵۱,۲۹۲
مطالبات از دولت	۱۱	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
تسهیلات اعطایی و مطالبات از اشخاص دولتی	۱۲	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
تسهیلات اعطایی غیر دولتی	۱۳	۰	۰	۹۷۸,۰۱۷,۴۵۵	۰	۶,۱۶۸	۰	۱,۶۹۲,۱۷۰,۴۲۹	۱۰۱,۳۶۱,۹۳۰	۰	۰	۹۲۴,۰۳۶,۳۳۵	۰	۰
سرمایه گذاری در سهام و سایر اوراق بهادار	۱۴	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
مطالبات از شرکتهای فرعی و وابسته	۱۵	۰	۰	۲,۵۵۳,۷۷۸	۰	۰	۰	۳,۴۱۳,۶۰۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سایر حسابهای دریافتنی	۱۶	۰	۰	۲۳,۱۱۵,۹۷۱	۰	۷۷۵,۷۲۵	۰	۹,۴۶۱,۳۲۱	۷۵,۵۷۹,۳۰۳	۰	۰	۰	۳,۲۲۰,۶۷۱	۰
دارایی های ثابت مشهود	۱۷	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
دارایی های نامشهود	۱۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سپرده قانونی	۱۹	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سایر دارایی ها	۲۰	(۹۰)	۰	(۱,۱۸۳,۴۹۸)	۰	۰	۰	۱۰,۰۰۰	۴,۰۰۵,۴۷۰,۷۴۵	۰	۰	۰	۰	۰
جمع دارایی های ارزی		۹۰,۷۸۴	۹۴۳	۱,۶۲۴,۸۳۰,۲۵۸	۱,۰۴۱	۷۵,۹۶۲,۵۸۳	۶۶,۹۱۴	۱,۷۹۹,۱۱۳,۰۰۶	۴,۶۵۷,۵۶۷,۵۳۷	۱۴,۸۳۲,۳۲۴	۱,۶۷۶,۸۸۷,۱۳۲	۲۳,۱۳۲,۳۹۴,۴۷۲	۴,۰۲۲,۵۵۱	۱,۵۵۱,۲۹۲
تعهدات مشتریان بابت اعتبارات اسنادی	۵۷-۱	۰	۰	۵۵۹,۸۲۸,۹۴۹	۰	۱,۳۶۶,۶۰۰	۰	۰	۵,۰۴۰,۲۵۶,۳۳۰	۰	۱۵۹,۳۴۷,۹۷۴	۰	۰	۰
تعهدات مشتریان بابت ضمانتنامه‌های صادره	۵۷-۲	۰	۰	۱۰۵,۳۶۹,۶۰۵	۰	۰	۰	۶۶,۰۷۳,۳۹۳	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سایر تعهدات مشتریان	۵۷-۳،۵۷-۴	۰	۰	۲۰۸,۶۶۹,۶۹۶	۰	۰	۰	۸۵۹,۲۱۳,۶۴۳	۰	۰	۰	۰	۰	۰
جمع تعهدات ارزی مشتریان		۰	۰	۸۷۳,۸۶۸,۲۵۰	۰	۱,۳۶۶,۶۰۰	۰	۹۲۵,۲۸۷,۰۳۶	۵,۰۴۰,۲۵۶,۳۳۰	۰	۱۵۹,۳۴۷,۹۷۴	۰	۰	۰
جمع دارایی های ارزی و تعهدات ارزی مشتریان		۹۰,۷۸۴	۹۴۳	۲,۴۹۸,۶۸۸,۵۰۹	۱,۰۴۱	۷۷,۳۲۹,۱۸۳	۶۶,۹۱۴	۲,۷۲۴,۴۰۰,۰۴۲	۹,۶۹۷,۸۲۳,۸۶۷	۱۴,۸۳۲,۳۲۴	۱,۸۳۶,۲۳۵,۱۰۶	۲۳,۱۳۲,۳۹۴,۴۷۲	۴,۰۲۲,۵۵۱	۱,۵۵۱,۲۹۲
معادل ریالی جمع دارایی های ارزی و تعهدات ارزی مشتریان- میلیون ریال		۱۰,۱۷۲	۶۱	۲۵۴,۸۶۶,۲۲۸	۵۸	۱,۹۴۷,۳۰۳	۶,۴۵۷	۲۴۵,۱۹۶,۰۰۴	۱۲۷,۹۴۳,۲۹۰	۱,۲۷۹,۵۵۵	۲,۲۹۷,۱۳۰	۱,۷۳۱,۹۹۱,۷۷۱	۵۸,۰۸۶	۳۹,۴۱۴
بدهی به بانکها و سایر موسسات اعتباری	۲۱	(۴۰۸,۸۷۰)	(۶۶۶)	(۲۶۲,۱۲۱,۳۶۲)	۰	(۱۱۱,۷۴۳)	۰	(۳۳۳,۴۵۶,۴۱۹)	(۸۰,۰۰۰,۰۰۰)	(۱۱,۸۰۳)	(۱,۰۸۶,۹۷۷)	۰	(۵۲,۰۳۲)	۰
سپرده های مشتریان	۲۲	(۵۰۲,۷۹۱)	(۹۷۱,۲۱۲)	(۱۷۹,۴۱۴,۴۴۶)	(۲۶,۴۱۱)	(۵۶,۷۴۱,۳۷۳)	(۱۷,۶۴۰)	(۸۰,۶۲۶,۱۲۵)	(۳۷۱,۴۷۶,۱۴۵)	(۹,۱۹۳,۰۵۶)	(۳۸۷,۰۲۳,۱۷۸)	(۷۱,۸۸۳,۰۴۴)	(۲۵۳,۴۹۲)	(۱۰,۵۹۵)
ذخیره مالیات عملکرد	۲۵	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
ذخایر و سایر بدهی ها	۲۶	۰	۰	(۳۱۲,۱۶۷,۸۴۴)	۰	۰	۰	(۴۳۳,۳۲۵,۲۷۸)	(۴,۰۶۶,۵۰۶,۹۰۰)	۰	۰	۰	۰	۰
حقوق صاحبان سپرده‌های سرمایه‌گذاری مدت‌دار	۲۸	۰	۰	(۵۵۱,۹۶۷,۹۸۸)	۰	(۱۳۰,۸۶۳)	۰	(۸۷۵,۴۱۱,۵۲۸)	(۴۴,۰۰۰,۰۰۰)	۰	۰	۰	۰	۰
جمع بدهی های ارزی		(۹۱۱,۶۶۱)	(۹۷۱,۸۷۸)	(۱,۳۰۵,۶۷۱,۶۴۱)	(۲۶,۴۱۱)	(۵۶,۹۸۳,۹۸۰)	(۱۷,۶۴۰)	(۱,۶۲۰,۸۱۹,۳۵۰)	(۴,۵۶۱,۹۸۳,۰۴۵)	(۹,۲۰۴,۸۵۹)	(۳۸۸,۱۱۰,۱۵۶)	(۷۱,۸۸۳,۰۴۴)	(۳۰۵,۵۲۴)	(۱۰,۵۹۵)
تعهدات بانک بابت اعتبارات اسنادی		۰	۰	(۵۵۹,۸۲۸,۹۴۹)	۰	(۱,۳۶۶,۶۰۰)	۰	۰	(۵,۰۴۰,۲۵۶,۳۳۰)	۰	(۱۵۹,۳۴۷,۹۷۴)	۰	۰	۰
تعهدات بانک بابت ضمانت نامه های صادره		۰	۰	(۱۰۵,۳۶۹,۶۰۵)	۰	۰	۰	(۶۶,۰۷۳,۳۹۳)	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سایر تعهدات بانک		۰	۰	(۲۰۸,۶۶۹,۶۹۶)	۰	۰	۰	(۸۵۹,۲۱۳,۶۴۳)	۰	۰	۰	۰	۰	۰
جمع تعهدات ارزی بانک		۰	۰	(۸۷۳,۸۶۸,۲۵۰)	۰	(۱,۳۶۶,۶۰۰)	۰	(۹۲۵,۲۸۷,۰۳۶)	(۵,۰۴۰,۲۵۶,۳۳۰)	۰	(۱۵۹,۳۴۷,۹۷۴)	۰	۰	۰
جمع بدهی های ارزی و تعهدات ارزی بانک		(۹۱۱,۶۶۱)	(۹۷۱,۸۷۸)	(۲,۱۷۹,۵۳۹,۸۹۱)	(۲۶,۴۱۱)	(۵۸,۳۵۰,۵۸۰)	(۱۷,۶۴۰)	(۲,۵۴۶,۱۰۶,۳۸۶)	(۹,۶۰۲,۲۳۹,۳۷۵)	(۹,۲۰۴,۸۵۹)	(۵۴۷,۴۵۸,۱۳۰)	(۷۱,۸۸۳,۰۴۴)	(۳۰۵,۵۲۴)	(۱۰,۵۹۵)
معادل ریالی جمع بدهی های ارزی و تعهدات ارزی بانک- میلیون ریال		(۱۰۲,۱۵۲)	(۶۳,۲۵۲)	(۲۲۲,۳۱۳,۰۶۹)	(۱,۴۶۹)	(۱,۴۶۹,۳۸۴)	(۱,۷۰۲)	(۲۲۹,۱۴۹,۵۷۵)	(۱۲۶,۶۸۲,۲۴۴)	(۷,۹۴۰,۸۴۸)	(۶۸۴,۸۷۰)	(۵,۲۸۲,۰۹۹)	(۴,۴۱۲)	(۲۶۹)
خالص وضعیت باز ارزی مثبت (منفی) هر ارز در تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۲۹		(۸۲۰,۸۷۷)	(۹۷۰,۹۳۴)	۳۱۹,۱۴۸,۶۱۷	(۲۵,۳۷۰)	۱۸,۹۷۸,۶۰۳	۴۹,۲۷۴	۱۷۸,۲۹۳,۶۵۶	۹۵,۵۸۴,۴۹۲	۵,۶۲۷,۴۶۵	۱,۲۸۸,۷۷۶,۹۷۷	۲۳,۰۶۰,۵۱۱,۴۲۸	۳,۷۱۷,۰۲۷	۱,۵۴۰,۶۹۷
معادل ریالی خالص وضعیت باز هر ارز در تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۲۹- میلیون ریال		(۹۱,۹۸۰)	(۶۳,۲۹۰)	۳۲,۵۵۳,۱۵۹	(۱,۴۱۱)	۴۷۷,۹۱۹	۴,۷۵۵	۱۶,۰۴۶,۴۲۹	۱,۲۶۱,۰۴۶	۴,۸۵۵	۱,۶۱۲,۲۶۰	۱,۷۲۶,۶۱۰	۵۳,۶۷۴	۳۹,۱۴۴
وضعیت باز هر ارز نسبت به سرمایه نظارتی در تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۲۹- درصد		-۰/۰۹٪	-۰/۰۶٪	۳۲/۹۵٪	۰/۰۰٪	۰/۴۸٪	۰/۰۰٪	۱۶/۲۴٪	۱/۲۸٪	۰/۰۰٪	۱/۶۳٪	۱/۷۵٪	۰/۰۵٪	۰/۰۴٪
وضعیت باز هر ارز نسبت به سرمایه نظارتی مبنای سایر نسبت‌های احتیاطی* در تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۲۹- درصد		-۰/۳۷٪	-۰/۱۴٪	۷۲/۸۱٪	۰/۰۰٪	۱/۰۷٪	۰/۰۱٪	۲۵/۸۹٪	۲/۸۲٪	۰/۰۱٪	۲/۶۱٪	۳/۸۶٪	۰/۱۲٪	۰/۰۹٪

بانک توسعه صادرات ایران
یادداشتهای توضیحی صورتهای مالی
سال مالی منتهی به ۲۹ اسفند ۱۳۹۸

۵-۵-۶۲-تحلیل ارزش در معرض خطر نرخ ارز(ادامه)

وضعیت ارزی بانک در پایان اسفند ماه سال ۱۳۹۸ به شرح زیر است :

	شماره یادداشت	ریال عربستان	ریال عمان	دینار عراق	سومونی تاجیکستان	بولیوار	روبل روسیه	درام ارمنستان	کرون دانمارک	کرون سوئد	کرون نروژ	لیر سوریه	دینار الجزایر
موجودی نقد	۹	۰	۰	۱۴,۵۰۲,۹۹۸,۸۸۳	۰	۰	۱۲,۵۰۲,۰۶۹	۵	۰	۰	۰	۰	۰
مطالبات از بانکها و سایر موسسات اعتباری	۱۰	۶۹	۵۸	۲,۴۰۰,۰۰۰	۶,۲۹۶,۳۷۷	۳۳,۵۹۰	۹۹,۷۴۱	۰	۰	۰	۰	۰	۰
مطالبات از دولت	۱۱	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
تسهیلات اعطایی و مطالبات از اشخاص دولتی	۱۲	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
تسهیلات اعطایی غیر دولتی	۱۳	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سرمایه گذاری در سهام و سایر اوراق بهادار	۱۴	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
مطالبات از شرکتهای فرعی و وابسته	۱۵	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سایر حسابهای دریافتنی	۱۶	۰	۰	۵,۶۳۱,۰۵۶,۲۸۷	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
دارایی های ثابت مشهود	۱۷	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
دارایی های نامشهود	۱۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سپرده قانونی	۱۹	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سایر دارایی ها	۲۰	۰	۰	۰	۰	۰	۹۳۶,۶۷۵	۰	۰	۰	۰	۰	۰
جمع دارایی های ارزی		۶۹	۵۸	۲۲,۱۳۴,۴۵۵,۱۷۱	۶,۲۹۶,۳۷۷	۳۳,۵۹۰	۱۳,۵۳۸,۴۸۵	۵	۰	۰	۰	۰	۰
تعهدات مشتریان بابت اعتبارات اسنادی	۵۷-۱	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
تعهدات مشتریان بابت ضمانتنامههای صادره	۵۷-۲	۰	۰	۱۰,۷۶۷,۱۵۶,۵۵۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۲۷۳,۳۱۰,۵۴۲	۰
سایر تعهدات مشتریان	۵۷-۳،۵۷-۴	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
جمع تعهدات ارزی مشتریان		۰	۰	۱۰,۷۶۷,۱۵۶,۵۵۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۲۷۳,۳۱۰,۵۴۲	۰
جمع دارایی های ارزی و تعهدات ارزی مشتریان		۶۹	۵۸	۳۲,۹۰۳,۶۱۱,۷۲۱	۶,۲۹۶,۳۷۷	۳۳,۵۹۰	۱۳,۵۳۸,۴۸۵	۵	۰	۰	۰	۲۷۳,۳۱۰,۵۴۲	۰
معادل ریالی جمع دارایی های ارزی و تعهدات ارزی مشتریان- میلیون ریال		۳	۱۴	۲,۵۵۱,۶۷۵	۶۰,۰۷۴	۳۱۱	۱۶,۶۶۶	۰	۰	۰	۰	۴۹,۴۶۹	۰
بدهی به بانکها و سایر موسسات اعتباری	۲۱	۰	۰	۰	۰	۰	(۱,۶۲۶,۷۰۷)	۰	۰	۰	۰	۰	۰
سپرده های مشتریان	۲۲	(۳۳,۲۷۹)	(۵,۵۱۳)	(۳۸۴,۰۵۹,۱۵۳)	۰	۰	(۷۰,۶۵۱,۴۸۱)	۰	(۳۱۰)	(۳۵,۲۰۸)	(۱۰,۴۳۳)	۰	۰
ذخیره مالیات عملکرد	۲۵	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
ذخایر و سایر بدهی ها	۲۶	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
حقوق صاحبان سپردههای سرمایهگذاری مدتدار	۲۸	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
جمع بدهی های ارزی		(۳۳,۲۷۹)	(۵,۵۱۳)	(۳۸۴,۰۵۹,۱۵۳)	۰	۰	(۷۲,۲۷۸,۱۸۸)	۰	(۳۱۰)	(۳۵,۲۰۸)	(۱۰,۴۳۳)	۰	۰
تعهدات بانک بابت اعتبارات اسنادی		۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
تعهدات بانک بابت ضمانت نامه های صادره		۰	۰	(۱۰,۷۶۷,۱۵۶,۵۵۰)	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	(۲۷۳,۳۱۰,۵۴۲)	۰
سایر تعهدات بانک		۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰
جمع تعهدات ارزی بانک		۰	۰	(۱۰,۷۶۷,۱۵۶,۵۵۰)	۰	۰	۰	۰	۰	۰	۰	(۲۷۳,۳۱۰,۵۴۲)	۰
جمع بدهی های ارزی و تعهدات ارزی بانک		(۳۳,۲۷۹)	(۵,۵۱۳)	(۱۱,۱۵۱,۲۱۵,۷۰۳)	۰	۰	(۷۲,۲۷۸,۱۸۸)	۰	(۳۱۰)	(۳۵,۲۰۸)	(۱۰,۴۳۳)	(۲۷۳,۳۱۰,۵۴۲)	۰
معادل ریالی جمع بدهی های ارزی و تعهدات ارزی بانک- میلیون ریال		(۸۲۱)	(۱,۳۲۶)	(۸۶۴,۷۷۷)	۰	۰	(۸۸,۹۷۴)	۰	(۴)	(۳۳۰)	(۹۲)	(۴۹,۴۶۹)	۰
خالص وضعیت باز ارزی مثبت (منفی) هر ارز در تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۲۹		(۳۳,۲۰۹)	(۵,۴۵۵)	۲۱,۷۵۲,۳۹۶,۰۱۷	۶,۲۹۶,۳۷۷	۳۳,۵۹۰	(۵۸,۷۳۹,۷۰۳)	۵	(۳۱۰)	(۳۵,۲۰۸)	(۱۰,۴۳۳)	۰	۰
معادل ریالی خالص وضعیت باز هر ارز در تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۲۹- میلیون ریال		(۸۱۹)	(۱,۳۱۲)	۱,۶۸۶,۸۹۸	۶۰,۰۷۴	۳۱۱	(۷۲,۳۰۹)	۰	(۴)	(۳۳۰)	(۹۲)	۰	۰
وضعیت باز هر ارز نسبت به سرمایه نظارتی در تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۲۹- درصد		۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۱/۷۱٪	۰/۰۶٪	۰/۰۰٪	-۰/۰۷٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪
وضعیت باز هر ارز نسبت به سرمایه نظارتی مبنای سایر نسبتهای احتیاطی* در تاریخ ۱۳۹۸/۱۲/۲۹- درصد		۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۳/۷۷٪	۰/۱۳٪	۰/۰۰٪	-۰/۱۶٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪	۰/۰۰٪