

| Faiz dərəcəsi riski - Həssaslıq üzrə Hesabat | | |
|---|----------------|--------------------|
| Tarix | 30 Dekabr 2019 | (min manat) |
| Faiz dərəcəsinə həssas cəmi aktivlər | | |
| 0-3 ay | 1,608,136 | |
| 3-6 ay | 386,540 | |
| 6-12 ay | 484,879 | |
| 12-24 ay | 319,242 | |
| 24-36 ay | 394,632 | |
| 36 aydan çox | 561,867 | |
| | <i>Cəmi</i> | <i>3,755,296</i> |
| Faiz dərəcəsinə həssas cəmi öhdəliklər | | |
| 0-3 ay | 667,274 | |
| 3-6 ay | 327,000 | |
| 6-12 ay | 218,174 | |
| 12-24 ay | 228,076 | |
| 24-36 ay | 215,547 | |
| 36 aydan çox | 887,858 | |
| | <i>Cəmi</i> | <i>2,543,928</i> |
| Qəp | | |
| 0-3 ay | 940,862 | |
| 3-6 ay | 59,540 | |
| 6-12 ay | 266,705 | |
| 12-24 ay | 91,166 | |
| 24-36 ay | 179,085 | |
| 36 aydan çox | (325,991) | |
| Kumulyativ qəp | | |
| 0-3 ay | 940,862 | |
| 3-6 ay | 1,000,403 | |
| 6-12 ay | 1,267,108 | |
| 12-24 ay | 1,358,273 | |
| 24-36 ay | 1,537,359 | |
| 36 aydan çox | 1,211,368 | |
| Faiz dərəcəsi şoku (bazis bəndi) | | |
| | | Stress-test |
| | | AZN - down 25 bps |
| | | USD - down 25 bps |
| | | EUR - down 10 bps |
| Xalis faiz gəlirinə təsir | 0 | (3,070) |
| Kapitala təsir | | |
| Məcmu kapital | 304,226 | 301,156 |
| <i>I dərəcəli kapital</i> | <i>342,695</i> | <i>342,695</i> |
| <i>II dərəcəli kapital</i> | <i>110,833</i> | <i>107,763</i> |
| Məcmu kapitalin adekvatlıq əmsali, % | 12.1% | 11.9% |

30-12-2019 tarixinə olan vəziyyət

| RİSK DƏRƏCƏSİ ÜZRƏ ÖLÇÜLMÜŞ AKTİVLƏRDƏN ASILI OLAN KAPİTALIN ADEKVATLIQ STANDARTLARININ (ƏMSALLARININ) HESABLANMASI | |
|---|------------------|
| I dərəcəli kapital | 342,836 |
| II dərəcəli kapital | 111,465 |
| Məcmu kapital | 454,301 |
| <i>Məcmu kapitaldan tutulmalar :</i> | <i>149,301</i> |
| Tutulmalardan sonra məcmu kapital | 304,999 |
| Risk dərəcəsi üzrə ölçülmüş aktivlər | 2,466,742 |
| | |
| Məcmu kapitalın adekvatlıq əmsalı, % | 12.4% |