

Faiz dərəcəsi riski - (31.12.2018)

Aktiv və öhdəliklərin durasiyası

Aktivlər	Məbləğ (min manatla)	Çəkili durasiya
Likvid aktivlər	1 445 783	0,00
Digər aktivlər	6 486 988	1,22
Cəmi aktivlər üzrə	7 932 771	1,22

Öhdəliklər	Məbləğ (min manatla)	Çəkili durasiya
Tələbli öhdəliklər	3 536 237	0,00
Digər öhdəliklər	3 235 009	1,33
Cəmi öhdəliklər üzrə	6 771 246	1,47

Cəmi kapital	1 161 526
---------------------	------------------

Durasiya QƏP	- 0,03
---------------------	---------------

Həssaslıq testləri və nəticələri

Tətbiq edilmiş şok (+/- bazis bəndi)	Mənfəət / Zərər (min manatla)	Mənfəət / Kapital Zərər / Kapital (%)
(+) 100 bps	4 774	0,4%
(-) 100 bps	- 6 978	-0,6%
(+) 200 bps	9 549	0,8%
(-) 200 bps	- 9 727	-0,8%
(+) 300 bps	14 324	1,2%
(-) 300 bps	- 11 704	-1,0%

- 100 bazis bəndi (bps) 1%-ə bərabərdir.
- Mənfəət və zərər dedikdə, kapitalın iqtisadi dəyərinin dəyişməsi nəzərdə tutulur.
- Kapital dedikdə Bankın xalis aktivləri (aktivlər - öhdəliklər) nəzərdə tutulur.