

Anlage D3b und E3b

**zur Verordnung der Finanzmarktaufsichtsbehörde (FMA) zum Vermögens-, Erfolgs- und
Risikoausweis (Vermögens-, Erfolgs- und Risikoausweis-Verordnung – VERA-V)**

Risikoausweis Auslandstochterbanken

Zinsrisiko

gemäß § 13 Abs. 1 und 2 VERA-V

A. Zinsrisiko Bankbuch

A.1. Aufsichtliche Ausreißertests

		Barwertänderung bei angenommener Zinsänderung
A.1.1	Paralleler Aufwärtsschock	5800100
A.1.2	Paralleler Abwärtsschock	5800200
A.1.3	Steepener Schock (steiler werdende Zinskurve)	5800300
A.1.4	Flattener Schock (flacher werdende Zinskurve)	5800400
A.1.5	Aufwärtsschock bei den kurzfristigen Zinsen	5800500
A.1.6	Abwärtsschock bei den kurzfristigen Zinsen	5800600

		Änderung im Nettozinsertrag bei angenommener Zinsänderung
A.1.7	Paralleler Aufwärtsschock	5800700
A.1.8	Paralleler Abwärtsschock	5800800

A.2. Allgemeine Angaben zur Ablaufbilanz

Methode der Risikoberechnung <i>[1 – Zinsbindungsmethode; 2 – Durationsmethode]</i>	5799999
Währung [gemäß ISO Code Tabelle]	<..>

A.3. Aktiva

Zinsbindungsmethode	bis 1 Monat (M)	> 1 bis 3 M	> 3 bis 6 M	> 6 M bis 1 Jahr (J)	> 1 bis 2 J	> 2 bis 3 J	> 3 bis 4 J	> 4 bis 5 J	> 5 bis 7 J	> 7 bis 10 J	> 10 bis 15 J	> 15 bis 20 J	über 20 J
Durationsmethode	bis 1 M	> 1 bis 3 M	> 3 bis 6 M	> 6 M bis 1 J	> 1 bis 1,86 J	> 1,86 bis 2,72 J	> 2,72 bis 3,55 J	> 3,55 bis 4,33 J	> 4,33 bis 5,79 J	> 5,79 bis 7,72 J	> 7,72 bis 10,38 J	> 10,38 bis 12,46 J	über 12,46 J
Summe Aktiva	5500100	5500200	5500300	5500400	5500500	5500600	5500700	5500800	5500900	5501000	5501100	5501200	5501300

A.5. Passiva

Zinsbindungsmethode	bis 1 Monat (M)	> 1 bis 3 M	> 3 bis 6 M	> 6 M bis 1 Jahr (J)	> 1 bis 2 J	> 2 bis 3 J	> 3 bis 4 J	> 4 bis 5 J	> 5 bis 7 J	> 7 bis 10 J	> 10 bis 15 J	> 15 bis 20 J	über 20 J
Durationsmethode	bis 1 M	> 1 bis 3 M	> 3 bis 6 M	> 6 M bis 1 J	> 1 bis 1,86 J	> 1,86 bis 2,72 J	> 2,72 bis 3,55 J	> 3,55 bis 4,33 J	> 4,33 bis 5,79 J	> 5,79 bis 7,72 J	> 7,72 bis 10,38 J	> 10,38 bis 12,46 J	über 12,46 J
Summe Passiva	5600100	5600200	5600300	5600400	5600500	5600600	5600700	5600800	5600900	5601000	5601100	5601200	5601300