

## **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. Allgemeine Angaben**

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

##### **A.2. Standardverfahren**

Barwertänderung bei angenommener Zinsänderung	5700010
In Prozent der Eigenmittel	5700011

##### **A.3. Internes Risikomanagement**

Barwertänderung bei angenommener Zinsänderung	5700020
In Prozent der Eigenmittel	5700021

#### A.4. 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
<b>Summe Aktiva</b>	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
<b>Summe Passiva</b>	5600100	5600200	5600300	5600400	5600500	5600600	5600700	5600800	5600900	5601000	5601100	5601200	5601300

### B. Zinsrisiko Handelsbuch

#### B.1. Allgemeine Angaben

Methode der Risikoberechnung [1 – Laufzeitbandmethode; 2 – Durationsmethode]	5799998
Sensitivität [J – Ja; N – Nein]	5799997
Währung [gemäß ISO Code Tabelle]	<..>

## B.2. Aktiva

	Zonen														
	Zone 1				Zone 2			Zone 3							
Laufzeitbandmethode > = 3	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		
Laufzeitbandmethode < 3	bis 1 M	> 1 bis 3 M	> 3 bis 6 M	> 6 M bis 1 Jahr (J)	> 1 bis 1,9 J	> 1,9 bis 2,8 J	> 2,8 bis 3,6 J	> 3,6 bis 4,3 J	> 4,3 bis 5,7 J	> 5,7 bis 7,3 J	> 7,3 bis 9,3 J	> 9,3 bis 10,6 J	> 10,6 bis 12 J	> 12 bis 20 J	über 20 J
Durationsmethode	bis 0,08 J	> 0,08 bis 0,25 J	> 0,25 bis 0,5 J	> 0,5 bis 1 J	> 1 bis 1,9 J	> 1,9 bis 2,8 J	> 2,8 bis 3,6 J	> 3,6 bis 4,3 J	> 4,3 bis 5,7 J	> 5,7 bis 7,3 J	> 7,3 bis 9,3 J	> 9,3 bis 10,6 J	> 10,6 bis 12 J	> 12 bis 20 J	über 20 J
<b>Summe Aktiva</b>	5501400	5501500	5501600	5501700	5501800	5501900	5502000	5502100	5502200	5502300	5502400	5502500	5502600	5502700	5502800

## B.3. Passiva

	Zonen														
	Zone 1				Zone 2			Zone 3							
Laufzeitbandmethode > = 3	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		
Laufzeitbandmethode < 3	bis 1 M	> 1 bis 3 M	> 3 bis 6 M	> 6 M bis 1 Jahr (J)	> 1 bis 1,9 J	> 1,9 bis 2,8 J	> 2,8 bis 3,6 J	> 3,6 bis 4,3 J	> 4,3 bis 5,7 J	> 5,7 bis 7,3 J	> 7,3 bis 9,3 J	> 9,3 bis 10,6 J	> 10,6 bis 12 J	> 12 bis 20 J	über 20 J
Durationsmethode	bis 0,08 J	> 0,08 bis 0,25 J	> 0,25 bis 0,5 J	> 0,5 bis 1 J	> 1 bis 1,9 J	> 1,9 bis 2,8 J	> 2,8 bis 3,6 J	> 3,6 bis 4,3 J	> 4,3 bis 5,7 J	> 5,7 bis 7,3 J	> 7,3 bis 9,3 J	> 9,3 bis 10,6 J	> 10,6 bis 12 J	> 12 bis 20 J	über 20 J
<b>Summe Passiva</b>	5601400	5601500	5601600	5601700	5601800	5601900	5602000	5602100	5602200	5602300	5602400	5602500	5602600	5602700	5602800