

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	[1 – Zinsbindungsmethode; 2 – Durationsmethode]
Währung [gemäß ISO Code Tabelle]	

A.2. Standardverfahren

Barwertänderung bei angenommener Zinsänderung	
In Prozent der Eigenmittel	

A.3. Internes Risikomanagement

Barwertänderung bei angenommener Zinsänderung	
In Prozent der Eigenmittel	

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
Summe Aktiva													

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													

B. Zinsrisiko Handelsbuch

B.1. Allgemeine Angaben

Methode der Risikoberechnung	<i>[1 – Laufzeitbandmethode; 2 – Durationsmethode]</i>
Sensitivität	<i>[J – Ja; N – Nein]</i>
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
Summe Aktiva															

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
Summe Passiva															

