

**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;<br/>2 – Durationsmethode]</i> |
| 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

|                            |                 |             |             |                      |                |                   |                   |                   |                   |                   |                    |                     |              |
|----------------------------|-----------------|-------------|-------------|----------------------|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|---------------------|--------------|
| <b>Zinsbindungsmethode</b> | 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    |
| <b>Durationsmethode</b>    | 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>        |                 |             |             |                      |                |                   |                   |                   |                   |                   |                    |                     |              |

#### A.5. Passiva

|                            |                 |             |             |                      |                |                   |                   |                   |                   |                   |                    |                     |              |
|----------------------------|-----------------|-------------|-------------|----------------------|----------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|--------------------|---------------------|--------------|
| <b>Zinsbindungsmethode</b> | 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    |
| <b>Durationsmethode</b>    | 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>       |                 |             |             |                      |                |                   |                   |                   |                   |                   |                    |                     |              |

### B. Zinsrisiko Handelsbuch

#### B.1. Allgemeine Angaben

|                                  |                                                    |
|----------------------------------|----------------------------------------------------|
| Methode der Risikoberechnung     | [1 – Laufzeitbandmethode;<br>2 – Durationsmethode] |
| Sensitivität                     | [1 – Ja; 2 – Nein]                                 |
| Währung [gemäß ISO Code Tabelle] |                                                    |

## B.2. Aktiva

[illegible]

### B.3. Passiva

[illegible]