

# **Anlage D3b und E3b**

## **Risikoausweis Auslandstöchter Zinsrisiko**

**gemäß § 13 Abs. 1 Z 2 VERA-V**

<b>Zinsrisiko</b>
-------------------

Zinsbindungsmethode (1)

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

Durationsmethode (2)

<b>5799999</b>
----------------

ISO-Code der Wahrung<sup>1</sup>

&lt;..&gt;

**AKTIVA**

Zinsbindungsmethode	bis 1 Monat (M)	> 1 – 3 M	>3 – 6 M	> 6 M bis 1 Jahr (J)	> 1 J bis 2 J	> 2 J bis 3 J	> 3 J bis 4 J	> 4 J bis 5 J	> 5 J bis 7 J	> 7 J bis 10 J	> 10 J bis 15 J	> 15 J bis 20 J	über 20 J
Durationsmethode	bis 1 M	> 1 – 3 M	>3 – 6 M	> 6 M bis 1 J	> 1 J bis 1,86 J	> 1,86 J bis 2,72 J	> 2,72 J bis 3,55 J	> 3,55 J bis 4,33 J	> 4,33 J bis 5,79 J	> 5,79 J bis 7,72 J	> 7,72 J bis 10,38 J	> 10,38 J 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

**PASSIVA**

Zinsbindungsmethode	bis 1 M	> 1 – 3 M	>3 – 6 M	> 6 M bis 1 J	> 1 J bis 2 J	> 2 J bis 3 J	> 3 J bis 4 J	> 4 J bis 5 J	> 5 J bis 7 J	> 7 J bis 10 J	> 10 J bis 15 J	> 15 J bis 20 J	über 20 J
Durationsmethode	bis 1 M	> 1 – 3 M	>3 – 6 M	> 6 M bis 1 J	> 1 J bis 1,86 J	> 1,86 J bis 2,72 J	> 2,72 J bis 3,55 J	> 3,55 J bis 4,33 J	> 4,33 J bis 5,79 J	> 5,79 J bis 7,72 J	> 7,72 J bis 10,38 J	> 10,38 J 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

**III. Standardverfahren**

Barwertanderung bei angenommener Zinsanderung:	5700010
--	---------

In % der anrechenbaren Eigenmittel:	5700011
-------------------------------------	---------

**IV. Internes Risikomanagement**

Barwertanderung bei angenommener Zinsanderung:	5700020
--	---------

In % der anrechenbaren Eigenmittel:	5700021
-------------------------------------	---------

<sup>1</sup> Landerkennzeichen gema Definition der Internationalen Organisation fur Standardisierung (ISO)

Zinsrisiko

Laufzeitbandmethode (1)	Laufzeitbandmethode/Durationsmethode
Durationsmethode (2)	5799998

Sensitivität	J/N
5799997	

ISO-Code der Währung <sup>1</sup>
<..>

AKTIVA															
Zonen	Zone 1				Zone 2				Zone 3						
Laufzeitbandmethode >= 3	bis 1 Monat (M)	>1 - 3 M	>3 - 6 M	>6 - 12 M	>1 - 2 Jahre (J)	>2 - 3 J	>3 - 4 J	>4 - 5 J	>5 - 7 J	>7 - 10 J	>10 - 15 J	>15 - 20 J	über 20 J		
Laufzeitbandmethode < 3	bis 1 M	>1 - 3 M	>3 - 6 M	>6 - 12 M	>1 - 1,9 J	>1,9 - 2,8 J	>2,8 - 3,6 J	>3,6 - 4,3 J	>4,3 - 5,7 J	>5,7 - 7,3 J	>7,3 - 9,3 J	>9,3 - 10,6 J	>10,6 - 12 J	>12 - 20 J	über 20 J
Durationsmethode	bis 0,08 J	>0,08 - 0,25 J	>0,25 - 0,5 J	>0,5 - 1 J	>1 - 1,9 J	>1,9 - 2,8 J	>2,8 - 3,6 J	>3,6 - 4,3 J	>4,3 - 5,7 J	>5,7 - 7,3 J	>7,3 - 9,3 J	>9,3 - 10,6 J	>10,6 - 12 J	>12 - 20 J	über 20 J
Summe Aktiva	5501400	5501500	5501600	5501700	5501800	5501900	5502000	5502100	5502200	5502300	5502400	5502500	5502600	5502700	5502800

PASSIVA															
Zonen	Zone 1				Zone 2				Zone 3						
Laufzeitbandmethode >= 3	bis 1 M	>1 - 3 M	>3 - 6 M	>6 - 12 M	>1 - 2 J	>2 - 3 J	>3 - 4 J	>4 - 5 J	>5 - 7 J	>7 - 10 J	>10 - 15 J	>15 - 20 J	über 20 J		
Laufzeitbandmethode < 3	bis 1 M	>1 - 3 M	>3 - 6 M	>6 - 12 M	>1 - 1,9 J	>1,9 - 2,8 J	>2,8 - 3,6 J	>3,6 - 4,3 J	>4,3 - 5,7 J	>5,7 - 7,3 J	>7,3 - 9,3 J	>9,3 - 10,6 J	>10,6 - 12 J	>12 - 20 J	über 20 J
Durationsmethode	bis 0,08 J	>0,08 - 0,25 J	>0,25 - 0,5 J	>0,5 - 1 J	>1 - 1,9 J	>1,9 - 2,8 J	>2,8 - 3,6 J	>3,6 - 4,3 J	>4,3 - 5,7 J	>5,7 - 7,3 J	>7,3 - 9,3 J	>9,3 - 10,6 J	>10,6 - 12 J	>12 - 20 J	über 20 J
Summe Passiva	5601400	5601500	5601600	5601700	5601800	5601900	5602000	5602100	5602200	5602300	5602400	5602500	5602600	5602700	5602800

<sup>1</sup> Länderkennzeichen gemäß Definition der Internationalen Organisation für Standardisierung (ISO)