

Anlage B3b und C3b

Risikoausweis konsolidiert Zinsrisiko

**gemäß § 9 Abs. 1 Z 2 und
Abs. 2 VERA-V**

BANKBUCH**Zinsrisiko**Zinsbindungsmethode
(1)

Durationsmethode (2)

Zinsbindungsmethode/Durationsmethode

ISO-Code der Währung¹

<..>

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
I. Posten in der Bilanz	Zinsfixe Forderungen													
	Zinsvariable Forderungen													
	Forderungen mit unbestimmter Zinsbindung													
	Sonstige Aktiva													
II. Posten unter der Bilanz	Synthetische Aktiva aus Derivaten													
	davon:													
	Zinsswaps													
	Zinstermingeschäfte													
	Zinsterminkontrakte (Futures) und zinsbezogene Index-Kontrakte													
	Zinsoptionen													
	Sonstige vergleichbare Verträge													
	FX Kontrakte													
	Summe Aktiva													

¹ Länderkennzeichen gemäß Definition der Internationalen Organisation für Standardisierung (ISO)

PASSIVA

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
I. Posten in der Bilanz	Zinsfixe Verbindlichkeiten													
	Zinsvariable Verbindlichkeiten													
	Verbindlichkeiten mit unbestimmter Zinsbindung													
	Sonstige Passiva und Eigenkapital													
II. Posten unter der Bilanz	Synthetische Passiva aus Derivaten													
	davon:													
	Zinsswaps													
	Zinstermingeschäfte													
	Zinsterminkontrakte (Futures) und zinsbezogene Index- Kontrakte													
	Zinsoptionen													
	Sonstige vergleichbare Verträge													
	FX Kontrakte													
	Summe Passiva													

III. Standardverfahren

Barwertänderung bei angenommener Zinsänderung:	
In % der Eigenmittel:	

IV. Internes Risikomanagement

Barwertänderung bei angenommener Zinsänderung:	
In % der Eigenmittel:	

HANDELSBUCH**Zinsrisiko**

Laufzeitbandmethode (1)

Laufzeitbandmethode/
Durationsmethode

Sensitivität

J/N

Durationsmethode (2)

ISO-Code der Währung¹

<..>

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															

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															

¹ Länderkennzeichen gemäß Definition der Internationalen Organisation für Standardisierung (ISO)

