



REGTECH | QUANT | FUND-DATA

Wir spezialisieren uns auf die Erstellung regulatorischer Meldeformate und die Berechnung komplexer quantitativer Services sowie der Lieferung hochwertiger Fondsdaten. Zu unseren langjährigen Kunden zählen Kapitalverwaltungsgesellschaften, Banken, Versicherungen, Family-Offices, Körperschaften öffentlichen Rechts sowie Pensions- und Vorsorgekassen bzw. deren Master KVG-Partner.

## **EBA ZINS-STRESSTESTS / CASH FLOW REPORTING FENION GMBH**



**Stefan Fischer MSc**

Managing Partner



**Mag. Nikolaus Sernetz**

Managing Partner



**DI Alexander Adamenko**

Managing Partner




# EBA ZINS-STRESSTESTS UND CASH FLOW REPORT.

**EBA  
STRESSTEST**


Die Europäische Bankenaufsichtsbehörde (EBA) führt Zinssatz-Stresstests durch um eine hohe Resilienz von Banken im Falle von Zinsänderungen zu gewährleisten. Diese Tests sollen die Widerstandsfähigkeit von Finanzinstituten bei der Aufrechterhaltung eines angemessenen Kapitalniveaus bei verschiedenen Zinsschwankungen messen. Auf Anfrage erstellt Fenion Zins-Stresstests und Cash-Flow Reports von Fonds.

## ZINS-STRESSTESTS UND CASH FLOW REPORTING


Erstellung der entsprechenden Vorlagen gemäß neuesten Standards 

Berechnung von Zinsszenarien 

Cashflow-Berechnung (falls gewünscht) 

Datenvalidierung und Qualitätssicherung 

Vollständig sichere und geprüfte IT-Infrastruktur 

Schnelle und genaue Lieferung sowie hervorragender Kundensupport 

Scenario	Currency	Present Value in Nominal Currency	Present Value in Reporting Currency	Change in Present Value in Reporting Currency	Share of Present Value	Share of Face Value
a) Standard Test: Parallel Shift +200 BP	EUR	191,678,226.36	191,678,226.36	-20,547,174.94	-11.97%	-11.54%
b) Standard Test: Parallel Shift -200 BP	EUR	191,678,226.36	191,678,226.36	24,054,066.77	14.01%	13.51%
c) Early Warning Indicator: Parallel Shift Upwards	EUR	191,678,226.36	191,678,226.36	-20,547,174.94	-11.97%	-11.54%
d) Early Warning Indicator: Parallel Shift Downwards	EUR	191,678,226.36	191,678,226.36	24,054,066.77	14.01%	13.51%
e) Early Warning Indicator: Steepening	EUR	191,678,226.36	191,678,226.36	-4,767,489.34	-2.78%	-2.68%
f) Early Warning Indicator: Flattening	EUR	191,678,226.36	191,678,226.36	1,417,602.15	0.83%	0.80%
g) Early Warning Indicator: Short-term Shock Upwards	EUR	191,678,226.36	191,678,226.36	-4,973,469.81	-2.90%	-2.79%
h) Early Warning Indicator: Short-term Shock Downwards	EUR	191,678,226.36	191,678,226.36	5,152,897.16	3.00%	2.89%

Year	Interest Payment	Maturity	Cash	Synthetic Cash	Total
2023	182421.0885		26804072		26986493.39
2024	703779.7974				703779.7974
2025	701333.77	1077000			1778333.77
2026	671292.52	4040000			4711292.52
2027	592945.77	4888000			5480945.77
2028	471643.0171	4871000			5342643.017
2029	354638.8904	3417000			3771638.89
2030	239111.75	2776000			3015111.75
2031	129929.25	2358000			2487929.25
2032	78500.21448	1763000			1841500.214
2033	36957.5	1234000			1270957.5

Reporting Date	Share Class Name	Internal Fund ID	Share Class ID	Share Class ISIN	Share Class Currency	Share Class Assets	Shares in Circulation	Share Class Price
31/08/2023	MSCI ESG EUR XXXXXX	0	1	DE000ABCD000	EUR	26986493.39	240000	100

## Zins-Stress-Szenarien

Nachfolgend die Stressszenarien:

- Standardtest: Parallele Verschiebung +200 BP
- Standardtest: Parallele Verschiebung -200 BP
- Frühwarnung: Parallele Verschiebung nach oben
- Frühwarnung: Parallele Verschiebung nach unten
- Frühwarnung: Anstieg
- Frühwarnung: Abflachung
- Frühwarnung: Kurzfristiger Schock nach oben
- Frühwarnung: Kurzfristiger Schock nach unten



Sie brauchen Unterstützung im Bereich Fondsdurchrechnung und regulatorisches Reporting?

KONTAKTIEREN SIE UNS

## KONTAKT



### ADRESSE

Hoher Markt 4, 1010 Wien



### TELEFON

+43 (1) 908 11 80



### EMAIL

office@fenion.at



**Mag. Nikolaus Sernetz**

Managing Partner

## IMPRESSUM

Fenion ist ein Spin-Off von Deloitte Österreich und agiert seit 2017 als unabhängiges Unternehmen. Unsere Dienstleistungen sind im Bereich des regulatorischen Meldewesens für institutionelle Investoren und den dazu notwendigen Datenlieferungen.

## KONTAKT

**Fenion GmbH**

Hoher Markt 4  
1010 Wien

**Bereich:** IT-Dienstleistungen

**UID:** ATU72994405

**FN:** 483557p

**FB-Gericht:** Wien

**E-Mail:** office@fenion.at

## SOCIAL MEDIA

Besuchen Sie uns auch auf unseren Social Media Kanälen und wir halten Sie über die neuesten Trends und Entwicklungen der Industrie auf dem Laufenden.

