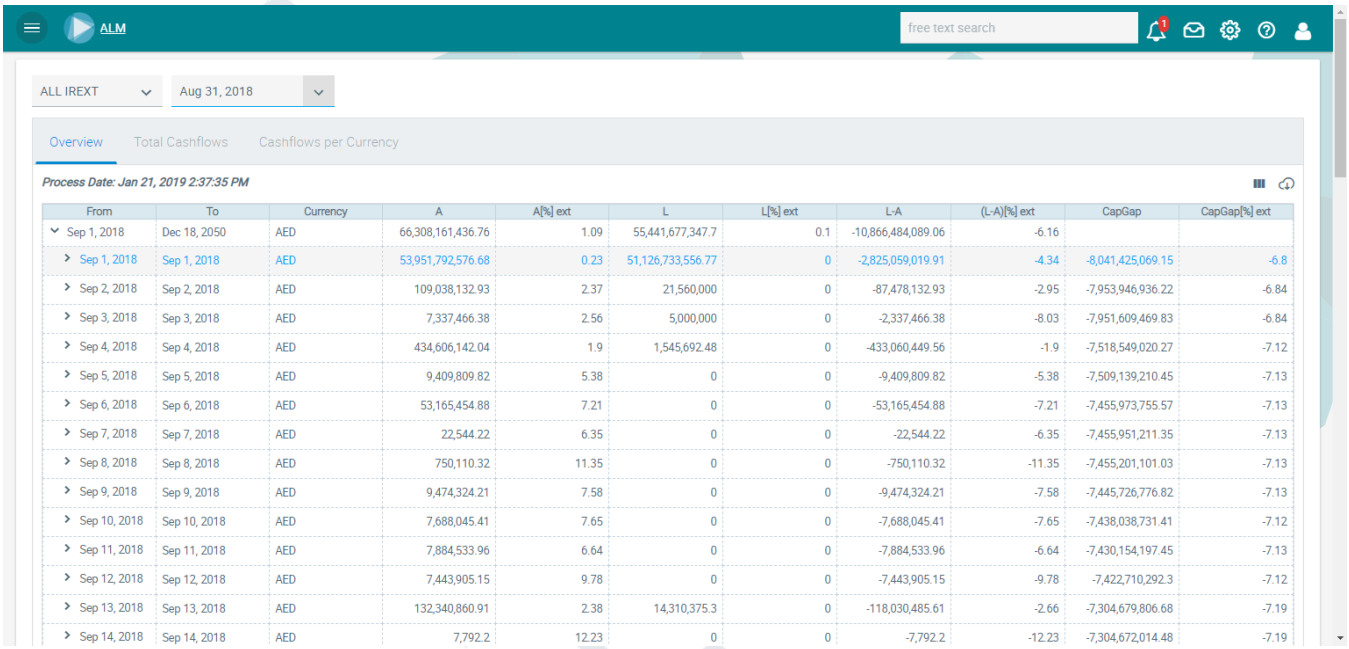
ALM / Zinsbindungsbilanz

Für ein Portfolio wie dem Bankbuch oder Handelsbuch erfolgt eine Beschreibung der Aktiva, Passiva, des Gaps (Passiva - Aktiva), des kumulierten Gaps und des kumulierten offenen Gaps. Zusätzlich sind auch die passenden Break-Even Sätze (durchschnittliche Zinssätze; alternativ auch Renditen) der Aktiva, Passiva, des Gap, des kumulierten Gaps und des offenen Gaps verfügbar. Die Anzeigewährung und die Struktur der Zeitraumstaffel ist frei definierbar. Es werden nur Kapitalzahlungen betrachtet.



From	To	Currency	A	A[%] ext	L	L[%] ext	L-A	(L-A)[%] ext	CapGap	CapGap[%] ext
Sep 1, 2018	Dec 18, 2050	AED	66,308,161,436.76	1.09	55,441,677,347.7	0.1	-10,866,484,089.06	-6.16		
Sep 1, 2018	Sep 1, 2018	AED	53,951,792,576.68	0.23	51,126,733,556.77	0	-2,825,059,019.91	-4.34	-8,041,425,069.15	-6.8
Sep 2, 2018	Sep 2, 2018	AED	109,038,132.93	2.37	21,560,000	0	-87,478,132.93	-2.95	-7,953,946,936.22	-6.84
Sep 3, 2018	Sep 3, 2018	AED	7,337,466.38	2.56	5,000,000	0	-2,337,466.38	-8.03	-7,951,609,469.83	-6.84
Sep 4, 2018	Sep 4, 2018	AED	434,606,142.04	1.9	1,545,692.48	0	-433,060,449.56	-1.9	-7,518,549,020.27	-7.12
Sep 5, 2018	Sep 5, 2018	AED	9,409,809.82	5.38	0	0	-9,409,809.82	-5.38	-7,509,139,210.45	-7.13
Sep 6, 2018	Sep 6, 2018	AED	53,165,454.88	7.21	0	0	-53,165,454.88	-7.21	-7,455,973,755.57	-7.13
Sep 7, 2018	Sep 7, 2018	AED	22,544.22	6.35	0	0	-22,544.22	-6.35	-7,455,951,211.35	-7.13
Sep 8, 2018	Sep 8, 2018	AED	750,110.32	11.35	0	0	-750,110.32	-11.35	-7,455,201,101.03	-7.13
Sep 9, 2018	Sep 9, 2018	AED	9,474,324.21	7.58	0	0	-9,474,324.21	-7.58	-7,445,726,776.82	-7.13
Sep 10, 2018	Sep 10, 2018	AED	7,688,045.41	7.65	0	0	-7,688,045.41	-7.65	-7,438,038,731.41	-7.12
Sep 11, 2018	Sep 11, 2018	AED	7,884,533.96	6.64	0	0	-7,884,533.96	-6.64	-7,430,154,197.45	-7.13
Sep 12, 2018	Sep 12, 2018	AED	7,443,905.15	9.78	0	0	-7,443,905.15	-9.78	-7,422,710,292.3	-7.12
Sep 13, 2018	Sep 13, 2018	AED	132,340,860.91	2.38	14,310,375.3	0	-118,030,485.61	-2.66	-7,304,679,806.68	-7.19
Sep 14, 2018	Sep 14, 2018	AED	7,792.2	12.23	0	0	-7,792.2	-12.23	-7,304,672,014.48	-7.19

© FERNBACH Financial Software S.A.