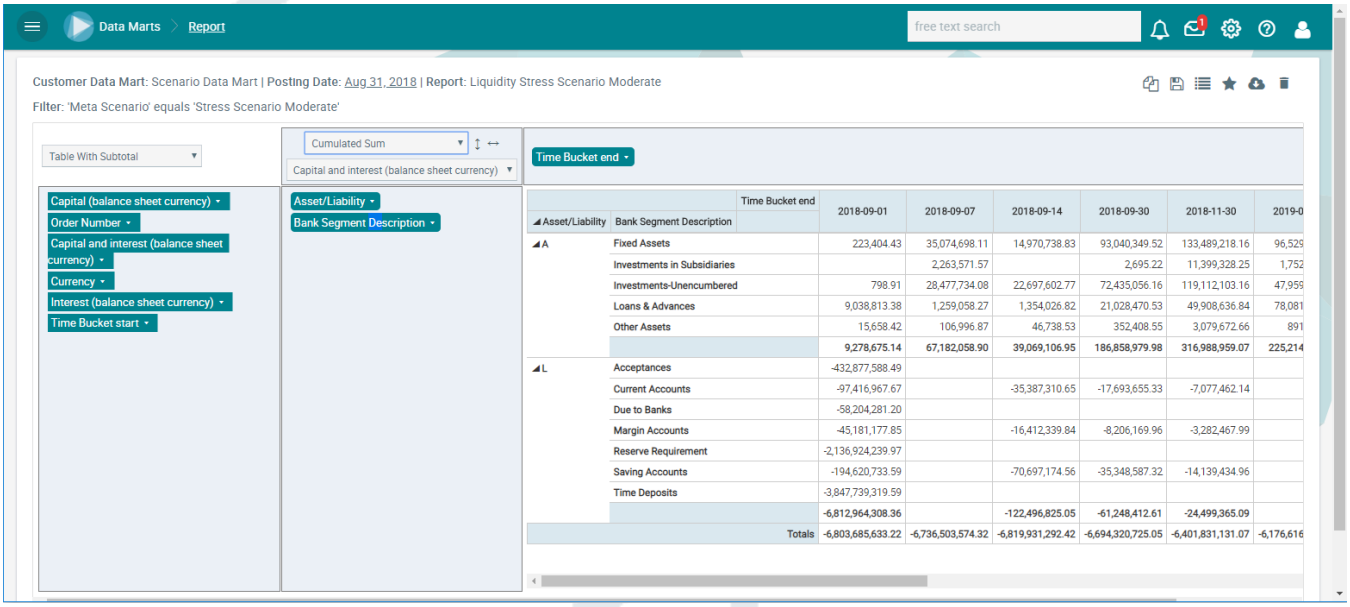
Stressszenario-Analyse

Es erfolgt eine Analyse der Liquiditätsablaufbilanz unter verschiedenen Stressszenarien. Dabei werden die vertragsmäßigen Cashflows der Geschäfte, Wertpapierpositionen und Konten um Szenarien erweitert, die mögliche Entwicklungen der Marktdaten oder des Kundenverhaltens widerspiegeln. Folgende Business Szenarien stehen dabei zur Verfügung:

- Ausfallszenarien (Kunden und einzelne Zahlungen)
- Verschiebung von Zahlungen
- erwartetes Neugeschäftsvolumen
- vorzeitige Zahlungen (Prepayments)
- Entwicklung von Marktdaten (Zinsen und Devisenkurse)
- Counterbalancing Capacity

Diese Szenarien können dabei beliebig miteinander kombiniert werden. Auch unterschiedliche Entwicklungen wie schlecht, moderat oder gut werden dabei parallel in unterschiedlichen Reports dargestellt. Mehr zu den verfügbaren Szenarien ist in Business Szenarien zu finden.