

Basis der Berechnung der Barwerte sind die Portfolios wie das Bankbuch oder das Handelsbuch. Die Barwerte werden auf Basis der Zero-Rates berechnet. Dabei wird eine Multi-Curve Bewertung, also die Verwendung von unterschiedlichen Zinsstrukturkurven pro Währung, unterstützt. Folgende Barwertkennziffern stehen zur Verfügung:

- Barwert der Inflows
- Barwert der Outflows
- Barwert der Gaps (Outflows minus Inflows)
- Barwert der kumulierten Gaps
- Barwert der kumulierten offenen Gaps

Die Barwerte werden entsprechend den frei definierbaren Zeiträumen der Zeitraumstaffeln aggregiert dargestellt. Die Berechnung erfolgt valutengenau in Originalwährung, also erst nach der Diskontierung werden die Werte aggregiert und in die frei definierbare Anzeigewährung umgerechnet.

ALM

free text search

ALL PVs

Dec 31, 2011

Overview

Total Cashflows

Cashflows per Currency

Process Date: Jan 14, 2019 5:47:43 PM

From	To	Currency	PV Inflows	PV Outflows	PV Gap	PV cumulated gap	PV cum open gaps
▼ Jan 1, 2012	Dec 18, 2050	EUR	14,384,241.15	-13,325,861.5	1,058,379.64		
▶ Jan 1, 2012	Jan 1, 2012	EUR	205,549.4	-226,323.82	-20,774.42	-20,774.42	1,079,154.06
▶ Jan 2, 2012	Jan 2, 2012	EUR	7,667.81	-350,421.78	-342,753.97	-363,528.39	1,421,908.04
▶ Jan 3, 2012	Jan 3, 2012	EUR	6.53	0	6.53	-363,521.86	1,421,901.5
▶ Jan 4, 2012	Jan 4, 2012	EUR	0.07	0	0.07	-363,521.79	1,421,901.44
▶ Jan 5, 2012	Jan 5, 2012	EUR	14.64	-5.25	9.4	-363,512.4	1,421,892.04
▶ Jan 6, 2012	Jan 6, 2012	EUR	57.84	0	57.84	-363,454.56	1,421,834.2
▶ Jan 15, 2012	Jan 15, 2012	EUR	468.48	-256.35	212.12	-363,242.43	1,421,622.08
▶ Jan 19, 2012	Jan 19, 2012	EUR	2.87	0	2.87	-363,239.56	1,421,619.21
▶ Jan 20, 2012	Jan 20, 2012	EUR	121.9	0	121.9	-363,117.66	1,421,497.31
▶ Jan 23, 2012	Jan 23, 2012	EUR	4.87	0	4.87	-363,112.79	1,421,492.43
▶ Jan 25, 2012	Jan 25, 2012	EUR	2.01	0	2.01	-363,110.78	1,421,490.43
▶ Jan 28, 2012	Jan 28, 2012	EUR	0.24	0	0.24	-363,110.55	1,421,490.19
▶ Jan 29, 2012	Jan 29, 2012	EUR	0.23	0	0.23	-363,110.31	1,421,489.96
▶ Jan 30, 2012	Jan 30, 2012	EUR	46.74	0	46.74	-363,063.57	1,421,443.22
▶ Jan 31, 2012	Jan 31, 2012	EUR	24,607.69	-21,187.25	3,420.45	-359,643.13	1,418,022.77
▶ Feb 1, 2012	Feb 29, 2012	EUR	505,686.84	-495,013.31	10,673.53	-348,969.6	1,407,349.24