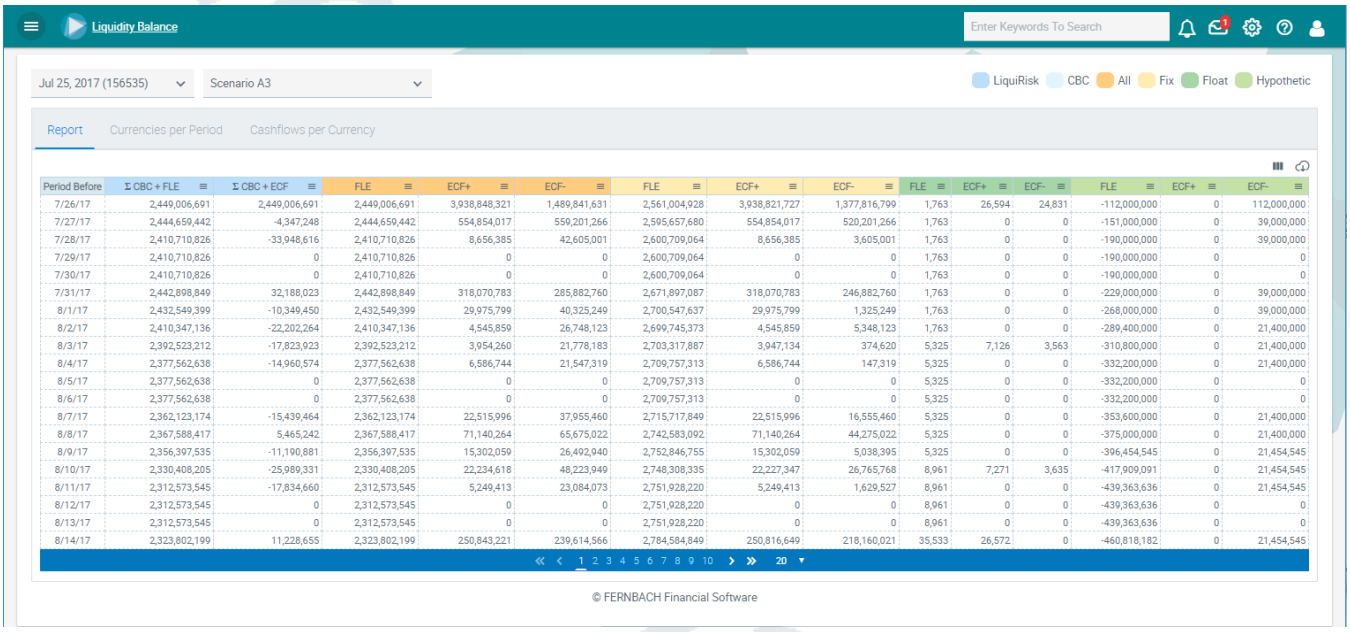
Liquidity

Es wird eine Liquiditätsablaufbilanz auf Basis der vertragsmäßig geplanten Cashflows – sowohl der Gesamtbilanz wie auch einzelner Portfolios wie Bankbuch oder Handelsbuch – dargestellt. Aufgeführt werden auch Geschäftsvorfälle wie ein zu erwartendes Neugeschäftsvolumen, ein erwartetes Zahlungsverhalten der Kunden oder Ausfallszenarien wie z. B. der 10 größten Kunden. Mehr zu unterstützten Szenarien ist in Business Szenarien zu finden.

Folgende Kennziffern sind verfügbar:

ECF+: Summe der eingehenden Cashflows des betrachteten Zeitraums
ECF-: Summe der ausgehenden Cashflows des betrachteten Zeitraums
ECF: Summe der Differenz von ausgehenden und eingehenden Cashflows je Zeitraum ((ECF+) - (ECF-))
FLE: Summe der ECF (Gaps) bis zum aktuellen Zeitraum

Das Ergebnis wird unter Verwendung frei definierbarer Zeitraumstaffeln sowohl für die vertragsmäßig geplanten als auch für die zu erwartenden Szenarien dargestellt. Dies kann auf Kapitalzahlungen beschränkt sein oder auch Zinszahlungen beinhalten.



Period Before	Σ CBC + FLE	Σ CBC + ECF	FLE	ECF+	ECF-	FLE	ECF+	ECF-	FLE	ECF+	ECF-	FLE	ECF+	ECF-
7/26/17	2,449,006,691	2,449,006,691	2,449,006,691	3,938,848,321	1,489,841,631	2,561,004,928	3,938,821,727	1,377,816,799	1,763	26,594	24,831	-112,000,000	0	112,000,000
7/27/17	2,444,659,442	-4,347,248	2,444,659,442	554,854,017	559,201,266	2,595,657,680	554,854,017	520,201,266	1,763	0	0	-151,000,000	0	39,000,000
7/28/17	2,410,710,826	-33,948,616	2,410,710,826	8,656,385	42,605,001	2,600,709,064	8,656,385	3,605,001	1,763	0	0	-190,000,000	0	39,000,000
7/29/17	2,410,710,826	0	2,410,710,826	0	0	2,600,709,064	0	0	1,763	0	0	-190,000,000	0	0
7/30/17	2,410,710,826	0	2,410,710,826	0	0	2,600,709,064	0	0	1,763	0	0	-190,000,000	0	0
7/31/17	2,442,898,849	32,188,023	2,442,898,849	318,070,783	285,882,760	2,671,897,087	318,070,783	246,882,760	1,763	0	0	-229,000,000	0	39,000,000
8/1/17	2,432,549,399	-10,349,450	2,432,549,399	29,975,799	40,325,249	2,700,547,637	29,975,799	1,325,249	1,763	0	0	-268,000,000	0	39,000,000
8/2/17	2,410,347,136	-22,202,264	2,410,347,136	4,545,859	26,748,123	2,699,745,373	4,545,859	5,348,123	1,763	0	0	-289,400,000	0	21,400,000
8/3/17	2,392,523,212	-17,823,923	2,392,523,212	3,954,260	21,778,183	2,703,317,887	3,947,134	374,620	5,325	7,126	3,563	-310,800,000	0	21,400,000
8/4/17	2,377,562,638	-14,960,574	2,377,562,638	6,586,744	21,547,319	2,709,757,313	6,586,744	147,319	5,325	0	0	-332,200,000	0	21,400,000
8/5/17	2,377,562,638	0	2,377,562,638	0	0	2,709,757,313	0	0	5,325	0	0	-332,200,000	0	0
8/6/17	2,377,562,638	0	2,377,562,638	0	0	2,709,757,313	0	0	5,325	0	0	-332,200,000	0	0
8/7/17	2,362,123,174	-15,439,464	2,362,123,174	22,515,996	37,955,460	2,715,717,849	22,515,996	16,555,460	5,325	0	0	-353,600,000	0	21,400,000
8/8/17	2,367,588,417	5,465,242	2,367,588,417	71,140,264	65,675,022	2,742,583,092	71,140,264	44,275,022	5,325	0	0	-375,000,000	0	21,400,000
8/9/17	2,356,397,535	-11,190,881	2,356,397,535	15,302,059	26,492,940	2,752,846,755	15,302,059	5,038,395	5,325	0	0	-396,454,545	0	21,454,545
8/10/17	2,330,408,205	-25,989,331	2,330,408,205	22,234,618	48,223,949	2,748,308,335	22,227,347	26,765,768	8,961	7,271	3,635	-417,909,091	0	21,454,545
8/11/17	2,312,573,545	-17,834,660	2,312,573,545	5,249,413	23,084,073	2,751,928,220	5,249,413	1,629,527	8,961	0	0	-439,363,636	0	21,454,545
8/12/17	2,312,573,545	0	2,312,573,545	0	0	2,751,928,220	0	0	8,961	0	0	-439,363,636	0	0
8/13/17	2,312,573,545	0	2,312,573,545	0	0	2,751,928,220	0	0	8,961	0	0	-439,363,636	0	0
8/14/17	2,323,802,199	11,228,655	2,323,802,199	250,843,221	239,614,566	2,784,584,849	250,816,649	218,160,021	35,533	26,572	0	-460,818,182	0	21,454,545