

Es wird eine Liquiditätsablaufbilanz dargestellt, die die einzelnen Gaps (Ausgänge minus Eingänge) in Bilanzwährung pro Zeitraum einer definierbaren Zeitraumstaffel ausweist. Es erfolgt dabei eine Gruppierung nach ein oder mehreren Kriterien wie Aktiva/Passiva oder Bankensegment. Damit wird eine Übersicht über die Gesamtbank geschaffen, die die Verteilung der Gaps dann über die Aktiva und Passiva getrennt nach den Bankensegmenten darstellt.

Neben den Gaps wird die Summe der Gaps der Aktiva und der Passiva aufgelistet. Die kumulierte Summe bis zum jeweiligen Zeitraum ist ebenfalls verfügbar.

Customer Data Mart: Base Data Mart | Posting Date: Aug.31.2018 | Report: Maturity Gap Analysis

Table: Capital accrued interest (balance sheet currency) | Sum | Time Bucket end

Asset/Liability	Bank Segment Description	Time Bucket end	2018-08-31	2018-09-08	2018-09-15	2018-10-01	2018-12-01	2019-03-01	2019-06-01	2019-09-01	2021
A	Fixed Assets		4,085,472.71	34,791,675.98	14,786,176.13	95,581,396.75	126,722,630.28	93,497,132.08	13,082,520.17		
	Investments in Subsidiaries		52,840.78	2,260,007.66		0.00	11,054,488.22	1,522,653.17	0.00	0.00	
	Investments-Unencumbered		3,646,371.76	28,544,724.68	21,391,886.46	72,901,410.53	114,719,511.94	46,813,493.86			
	Loans & Advances		189,675,893.41	1,065,666,233.72	3,768,633.11	125,387,919.47	221,494,047.83	144,996,099.86	90,257,103.98	59,727,813.16	915,38
	Other Assets		4,535,024.36	5,172,595.75	2,089,381.89	4,669,177.21	25,463,346.72	82,953,102.67	8,603,945.13	25,535.14	52,72
	null		31,803,214.23	53,429,686,999.53	124,419,088.16	219,926,000.00	274,116,403.31	0.00	0.00	0.00	214,78
L	Acceptances		0.00	-432,877,588.49							
	Current Accounts		0.00	-387,592,915.20							
	Due to Banks		0.00	-58,204,281.20							
	Loans & Advances		0.00	0.00							
	Margin Accounts		0.00	-179,762,364.52							
	Reserve Requirement		0.00	-2,136,924,239.97							
	Saving Accounts		0.00	-774,337,564.88							
	Time Deposits		0.00	-3,847,739,319.59							
	null		-13,508,496.12	-43,337,400,975.37	-14,310,375.30	0.00	-298,803,128.65	-183,657,500.00	0.00	0.00	-661,14
	Totals		220,290,321.13	3,411,282,988.10	152,144,790.45	518,465,903.96	474,767,299.65	186,124,981.64	111,943,569.28	59,753,348.30	521,78

© FERNBACH Financial Software