

Mark to market ist die Ermittlung des (barwertigen) Zinsergebnisses für das ausgewählte Portfolio, das sich ergibt, falls die jeweilige Position mit Geld- oder Kapitalmarktzinssätzen geschlossen wird. Es werden dabei die Zinsen auf Basis der Differenz der Kapitalzahlungen mit den aktuellen Marktzinssätzen berechnet und anschließend mit den offenen Zinspositionen (Ausgänge minus Eingänge von Zinszahlungen) verglichen. Die Differenz stellt dann den Mark to market Betrag dar.

Diese Kalkulation wird auf Basis der aktuellen Marktdaten auch als Barwert angeboten. Eine Kalkulation auf Basis von Zinsszenarien ist ebenfalls möglich.

☰
▶ ALM

free text search

🔔
✉
⚙
?
👤

ALL MTM ▾
Dec 31, 2011 ▾

Overview
Total Cashflows
Cashflows per Currency

Process Date: Jan 15, 2019 11:35:43 AM

From	To	Currency	Gap	INT AMOUNT	MTM B	PV MTM
▼ Jan 1, 2012	Dec 18, 2050	EUR	28,629,406,217.54	65,863.3	657,456.16	600,701.98
▶ Jan 1, 2012	Jan 1, 2012	EUR	431,183,005.26	-0.41	697	696.99
▶ Jan 2, 2012	Jan 2, 2012	EUR	350,402,449.51	-85.67	6,892.27	6,890.62
▶ Jan 3, 2012	Jan 3, 2012	EUR	3,951.56	0	2.58	2.58
▶ Jan 4, 2012	Jan 4, 2012	EUR	60.25	0	0.01	0.01
▶ Jan 5, 2012	Jan 5, 2012	EUR	16,772.77	0	3.13	3.13
▶ Jan 6, 2012	Jan 6, 2012	EUR	50,465.9	0.04	7.46	7.45
▶ Jan 15, 2012	Jan 15, 2012	EUR	611,969.24	0.01	115.28	115.24