

Für variabel verzinsliche Produkte kann das Fixing von zukünftigen Kundenzinsen simuliert werden. Es erfolgt dabei eine Simulation der Marktzinsen und des sich daraus ergebenden Kundenzinses. Für die Erstellung eines Zinsszenarios können beliebig viele Stützstellen mit relativen oder absoluten Zinsshifts definiert werden. Nicht vorhandene Zwischenwerte werden mit linearer Interpolation aufgefüllt. Die zu verwendende Zinsstrukturkurve wird über Geschäftskriterien wie Geschäftstyp, Währung, Marktdatenquelle (Rate Source) ermittelt. Dabei können für eine Währung unterschiedliche Zinsstrukturkurven verwendet werden (Multi-Curve Bewertung).

Für jedes Zinsszenario werden die erwarteten Zinscashflows der Geschäfte neu berechnet. Bei Annuitäten oder kapitalisierten Zinsen werden die entsprechenden Kapitaländerungen ebenfalls angepasst. Für ein Portfolio mit zinsvariablen Geschäften können unterschiedliche Zinsszenarien parallel betrachtet werden.

Interest Scenario Details

free text search

Task list

Liquidity

ALM

Scenarios

Meta Scenarios

Interest Scenarios

Interest Scenarios

Interest Scenario Details

Liquidity Scenario Portfolio

Relative Dates

Time Windows

Interest scenario *	Interest Duration *	IF	Bid	Mid	Offer
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	24Y - 24 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	25Y - 25 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	26Y - 26 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	27Y - 27 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	28Y - 28 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	29Y - 29 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	2M - 2 Months	-1.6	-1.6	-1.6	-1.6
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	2Y - 2 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	30Y - 30 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	3M - 3 Months	-0.2	-0.2	-0.2	-0.2
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	3Y - 3 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	4M - 4 Months	1.2	1.2	1.2	1.2
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	4Y - 4 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	5M - 5 Months	2.6	2.6	2.6	2.6
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	5Y - 5 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	6M - 6 Months	4	4	4	4
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	6Y - 6 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	7M - 7 Months	3.08	3.08	3.08	3.08
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	7Y - 7 Years	-1.5	-1.5	-1.5	-1.5
Butterfly - Butterfly -300 BP 400 BP -150 BP	8M - 8 Months	2.17	2.17	2.17	2.17

«

<

1

2

3

>

»

20

© FERNBACH Financial Software