

Es erfolgt eine Analyse der Liquiditätsablaufbilanz unter verschiedenen Stressszenarien. Dabei werden die vertragmäßigen Cashflows der Geschäfte, Wertpapierpositionen und Konten um Szenarien erweitert, die mögliche Entwicklungen der Marktdaten oder des Kundenverhaltens widerspiegeln. Folgende Business Szenarien stehen dabei zur Verfügung:

- Ausfallszenarien (Kunden und einzelne Zahlungen)
- Verschiebung von Zahlungen
- erwartetes Neugeschäftsvolumen
- vorzeitige Zahlungen (Prepayments)
- Entwicklung von Marktdaten (Zinsen und Devisenkurse)
- Counterbalancing Capacity

Diese Szenarien können dabei beliebig miteinander kombiniert werden. Auch unterschiedliche Entwicklungen wie schlecht, moderat oder gut werden dabei parallel in unterschiedlichen Reports dargestellt. Mehr zu den verfügbaren Szenarien ist in [Business Szenarien](#) zu finden.

Table With Subtotal

Capital (balance sheet currency) -

Order Number -

Capital and interest (balance sheet currency) -

Currency -

Interest (balance sheet currency) -

Time Bucket start -

Cumulated Sum

Capital and interest (balance sheet currency)

Asset/Liability -

Bank Segment Description -

Time Bucket end

	Time Bucket end	2018-09-01	2018-09-07	2018-09-14	2018-09-30	2018-11-30	2019-0
▲ Asset/Liability	Bank Segment Description						
▲ A	Fixed Assets	223,404.43	35,074,698.11	14,970,738.83	93,040,349.52	133,489,218.16	96,525
	Investments in Subsidiaries		2,263,571.57		2,695.22	11,399,328.25	1,752
	Investments-Unencumbered	798.91	28,477,734.08	22,697,602.77	72,435,056.16	119,112,103.16	47,959
	Loans & Advances	9,038,813.38	1,259,058.27	1,354,026.82	21,028,470.53	49,908,636.84	78,081
	Other Assets	15,658.42	106,996.87	46,738.53	352,408.55	3,079,672.66	891
		9,278,675.14	67,182,058.90	39,069,106.95	186,858,979.98	316,988,959.07	225,214
▲ L	Acceptances	-432,877,588.49					
	Current Accounts	-97,416,967.67		-35,387,310.65	-17,693,655.33	-7,077,462.14	
	Due to Banks	-58,204,281.20					
	Margin Accounts	-45,181,177.85		-16,412,339.84	-8,206,169.96	-3,282,467.99	
	Reserve Requirement	-2,136,924,239.97					
	Saving Accounts	-194,620,733.59		-70,697,174.56	-35,348,587.32	-14,139,434.96	
	Time Deposits	-3,847,739,319.59					
		-6,812,964,308.36		-122,496,825.05	-61,248,412.61	-24,499,365.09	
	Totals	-6,803,685,633.22	-6,736,503,574.32	-6,819,931,292.42	-6,694,320,725.05	-6,401,831,131.07	-6,176,616