Curve

Properties
alpha : numeric
american_flag : numeric
basis : numeric
cap : string
compounding_freq : string
compounding_type : string
curve_function : string
curve_parameter : numeric
day_count_convention : string
description : string
floor : string
id : string
increments : string
method_extrapolation : string
method_interpolation : string
name : string
nodes : numeric
rates_base : numeric
rates_mc : numeric
rates_stress : numeric
shocktype_mc : string
shocktype_stress : string
sln_level : numeric
timestep_mc : cell
type : string
ufr : numeric

Methods
Curve
apply_rf_shock
get
getRate
getValue
isProp
set

Index

Properties
currency : string
description : string
id : string
increments : cell
index_function : string
index_parameter : numeric
name : string
scenario_mc : numeric
scenario_stress : numeric
shift_type : numeric
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric

Methods
Index
get
getValue
isProp
set

Instrument

Properties
asset_class : string
currency : string
description : string
id : string
name : string
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric

Methods
Instrument
getValue
isProp
valuate

Matrix

Properties
components : cell
components_xx : cell
components_yy : cell
description : string
id : string
matrix : numeric
name : string
type : string

Methods
Matrix
get
getValue
isProp
set

Parameter

Properties
description : string
id : string
name : string
type : string

Methods
Parameter
get
isProp
set

Riskfactor

Properties
description : string
id : string
kurt : numeric
mean : numeric
model : string
mr_level : numeric
mr_rate : numeric
name : string
node : numeric
node2 : numeric
node3 : numeric
scenario_mc : string
scenario_stress : numeric
shift_type : numeric
shocktype_mc : string
skew : numeric
sln_level : numeric
std : numeric
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric

Methods
Riskfactor
get
getValue
isProp
set

Surface

Properties
axis_x : numeric
axis_x_name : string
axis_y : numeric
axis_y_name : string
axis_z : numeric
axis_z_name : string
basis : numeric
compounding_freq : string
compounding_type : string
day_count_convention : string
description : string
id : string
method_interpolation : string
moneyness_type : string
name : string
riskfactors : cell
shock_struct : numeric
type : string
values_base : numeric

Methods
Surface
apply_rf_shocks
apply_stress_shocks
get
getValue
interpolate
isProp
set

Bond

Properties
accrued_interest : numeric
alpha : numeric
annuity_amount : numeric
asset_class : string
basis : numeric
business_day_direction : numeric
business_day_rule : numeric
calibration_flag : numeric
call_schedule : string
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
cf_values_mc : numeric
cf_values_stress : numeric
clean_value_base : numeric
cms_comp_type : string
cms_convex_model : string
cms_model : string
cms_sliding_term : numeric
cms_spread : numeric
cms_term : numeric
compounding_freq : numeric
compounding_type : string
convex_adj : bool
convexity : numeric
coupon_generation_method : string
coupon_prepay : string
coupon_rate : numeric
cpi_historical_curve : string
cpi_index : string
currency : string
day_count_convention : string
description : string
discount_curve : string
dollar_convexity : numeric
dollar_duration : numeric
dv01 : numeric
eff_convexity : numeric
eff_duration : numeric
embedded_option_flag : bool
embedded_option_value : numeric
enable_business_day_rule : numeric
fixed_annuity : numeric
fva_type : string
fwd_sliding_term : numeric
fwd_term : numeric
id : string
in_arrears : bool
infl_exp_curve : string
infl_exp_lag : string
ir_shock : numeric
issue_date : string
key_rate_eff_convex : numeric
key_rate_eff_dur : numeric
key_rate_mon_convex : numeric
key_rate_mon_dur : numeric
key_rate_shock : numeric
key_rate_width : numeric
key_term : numeric
last_coupon_date : numeric
last_reset_rate : numeric
long_first_period : numeric
long_last_period : numeric
mac_duration : numeric
maturity_date : numeric
mod_duration : numeric
name : string
notional : numeric
notional_at_end : numeric
notional_at_start : numeric
outstanding_balance : numeric
prepayment_curve : string
prepayment_flag : bool
prepayment_procedure : string
prepayment_rate : numeric
prepayment_source : string
prepayment_type : string
principal_payment : numeric
prorated : bool
psa_factor_term : numeric
put_schedule : string
pv01 : numeric
rate_composition : string
reference_curve : string
sigma : numeric
soy : numeric
spot_value : numeric
spread : numeric
spread_curve : string
spread_duration : numeric
stochastic_rf_type : string
stochastic_riskfactor : string
stochastic_surface : string
strike_rate : numeric
sub_type : string
t_degree_freedom : numeric
term : numeric
timestep_mc : cell
timestep_mc_cf : cell
treenodes : numeric
type : string
underlying_maturity_date : string
use_annuity_amount : numeric
use_indexation_lag : bool
use_outstanding_balance : numeric
use_principal_pmt : numeric
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric
vola_spread : numeric
vola_surface : string
ytm : numeric

Methods
Bond
calc_key_rates
calc_sensitivities
calc_spread_over_yield
calc_value
calc_yield_to_mat
get
getCF
rollout
set

CapFloor

Properties
CapFlag : bool
accrued_interest : numeric
asset_class : string
basis : numeric
business_day_direction : numeric
business_day_rule : numeric
calibration_flag : numeric
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
cf_values_mc : numeric
cf_values_stress : numeric
cms_comp_type : string
cms_convex_model : string
cms_model : string
cms_sliding_term : numeric
cms_spread : numeric
cms_term : numeric
compounding_freq : numeric
compounding_type : string
convex_adj : bool
convexity : numeric
coupon_generation_method : string
coupon_rate : numeric
cpi_historical_curve : string
cpi_index : string
currency : string
day_count_convention : string
description : string
discount_curve : string
dollar_convexity : numeric
dollar_duration : numeric
dv01 : numeric
eff_convexity : numeric
eff_duration : numeric
enable_business_day_rule : numeric
id : string
in_arrears : bool
infl_exp_curve : string
infl_exp_lag : string
ir_shock : numeric
issue_date : string
last_reset_rate : numeric
long_first_period : numeric
long_last_period : numeric
mac_duration : numeric
maturity_date : string
mod_duration : numeric
model : string
name : string
notional : numeric
notional_at_end : numeric
notional_at_start : numeric
prorated : bool
pv01 : numeric
reference_curve : string
soy : numeric
spread : numeric
spread_duration : numeric
strike : numeric
sub_type : string
term : numeric
theta : numeric
timestep_mc : cell
timestep_mc_cf : cell
type : string
use_indexation_lag : bool
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric
vega : numeric
vola_shock : numeric
vola_spread : numeric
vola_surface : string
ytm : numeric

Methods
CapFloor
calc_sensitivities
calc_value
calc_vola_spread
get
getCF
rollout
set

Cash

Properties
asset_class : string
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
currency : string
description : string
discount_curve : string
id : string
name : string
sub_type : string
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric

Methods
Cash
calc_value
get
set

Debt

Properties
asset_class : string
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
convexity : numeric
currency : string
description : string
discount_curve : string
id : string
name : string
sub_type : string
term : numeric
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric

Methods
Debt
calc_value
get
set

Forward

Properties
asset_class : string
basis : numeric
calc_price_from_netbasis : bool
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
component_weight : numeric
compounding_freq : string
compounding_type : string
convenience_yield : numeric
currency : string
day_count_convention : string
description : string
discount_curve : string
dividend_yield : numeric
foreign_curve : string
id : string
issue_date : string
maturity_date : string
multiplier : numeric
name : string
net_basis : numeric
spread : numeric
storage_cost : numeric
strike_price : numeric
sub_type : string
theo_delta : numeric
theo_domestic_rho : numeric
theo_foreign_rho : numeric
theo_gamma : numeric
theo_price : numeric
theo_rho : numeric
theo_theta : numeric
theo_vega : numeric
timestep_mc : cell
type : string
underlying_id : string
underlying_price_base : numeric
underlying_sensitivity : numeric
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric

Methods
Forward
calc_sensitivities
calc_value
get
set

Option

Properties
asset_class : string
averaging_monitoring : string
averaging_rule : string
averaging_type : string
barrierlevel : numeric
basis : numeric
binary_type : string
calibration_flag : numeric
call_flag : bool
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
compounding_freq : string
compounding_type : string
currency : string
day_count_convention : string
discount_curve : string
div_yield : numeric
id : string
lookback_type : string
maturity_date : string
multiplier : numeric
name : string
option_type : string
outorin : string
payoff_strike : numeric
pricing_function_american : string
rebate : numeric
spot : numeric
spread : numeric
strike : numeric
sub_type : string
theo_delta : numeric
theo_gamma : numeric
theo_omega : numeric
theo_rho : numeric
theo_theta : numeric
theo_vega : numeric
timestep_mc : cell
timesteps_size : numeric
type : string
underlying : string
underlying_price_base : numeric
upordown : string
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric
vola_sensi : numeric
vola_spread : numeric
vola_surface : string
willowtree_nodes : numeric

Methods
Option
calc_greeks
calc_greeks_basket_beisser
calc_value
calc_value_basket_beisser
calc_vola_spread
get
set

Sensitivity

Properties
asset_class : string
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
currency : string
description : string
id : string
idio_vola : numeric
model : string
name : string
riskfactors : cell
sensitivities : numeric
sub_type : string
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric

Methods
Sensitivity
get
set

Stochastic

Properties
asset_class : string
currency : string
description : string
id : string
name : string
quantile_base : numeric
stochastic_curve : string
stochastic_rf_type : string
stochastic_riskfactor : string
sub_type : string
t_degree_freedom : numeric
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric

Methods
Stochastic
calc_value
get
set

Swaption

Properties
asset_class : string
basis : numeric
calibration_flag : numeric
call_flag : bool
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
compounding_freq : numeric
compounding_type : string
currency : string
day_count_convention : string
description : string
discount_curve : string
effective_date : string
id : string
implied_volatility : numeric
maturity_date : string
model : string
multiplier : numeric
name : string
no_payments : numeric
spot : numeric
spread : numeric
strike : numeric
sub_type : string
tenor : numeric
theo_delta : numeric
theo_gamma : numeric
theo_rho : numeric
theo_theta : numeric
theo_vega : numeric
type : string
und_fixed_leg : string
und_fixed_value : numeric
und_float_value : numeric
und_floating_leg : string
underlying : string
use_underlyings : bool
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric
vola_sensi : numeric
vola_spread : numeric
vola_surface : string

Methods
Swaption
calc_greeks
calc_value
calc_vola_spread
get
set

Synthetic

Properties
asset_class : string
basis : numeric
basket_vola_type : string
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
compounding_freq : string
compounding_type : string
correlation_matrix : string
currency : string
day_count_convention : string
description : string
discount_curve : string
id : string
instr_vol_surfaces : cell
instruments : cell
is_basket : bool
name : string
sub_type : string
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric
weights : numeric

Methods
Synthetic
calc_value
get
set