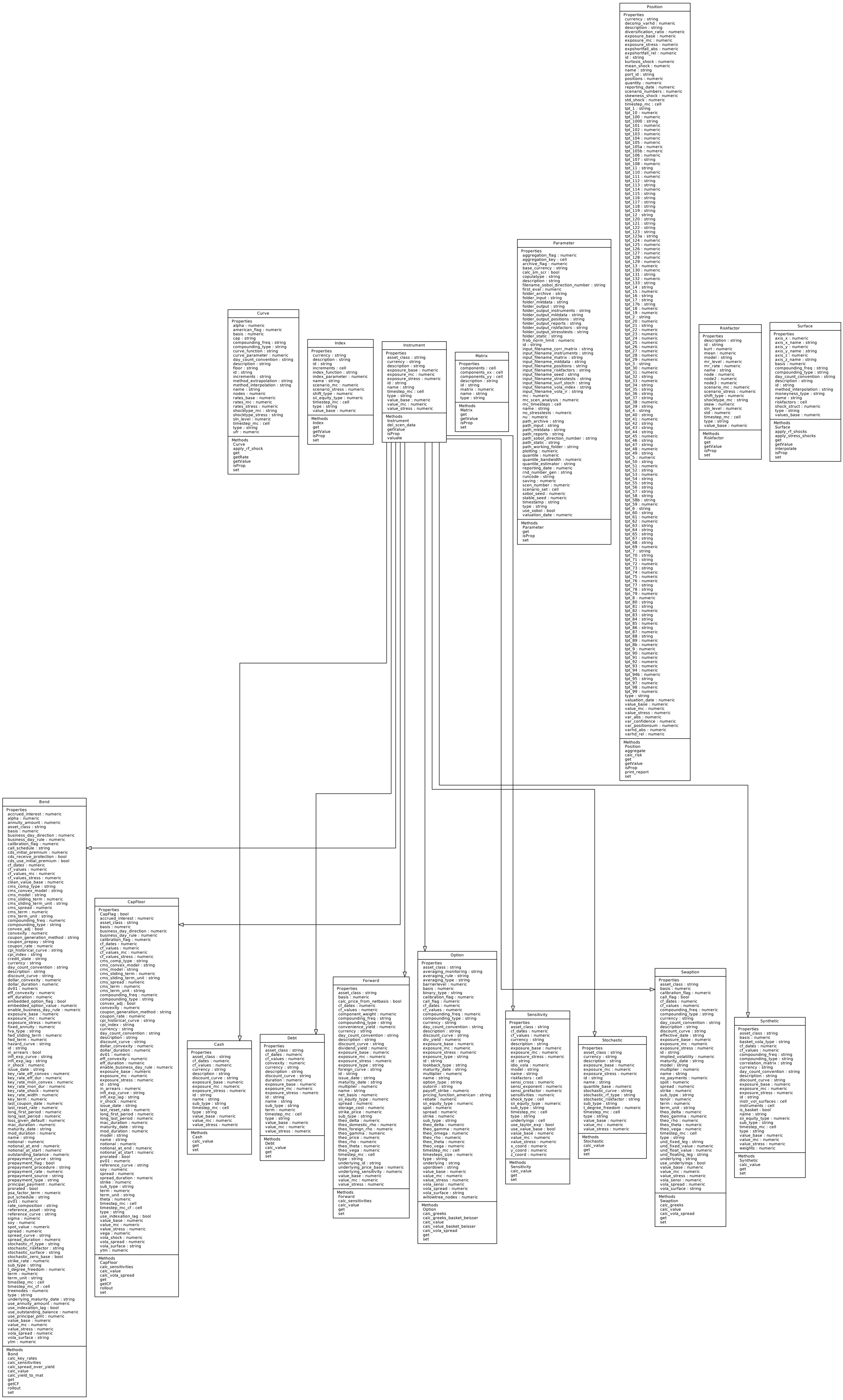
Position
Properties
currency : string
decomp_varhd : numeric
description : string
diversification_ratio : numeric
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
expshortfall_abs : numeric
expshortfall_rel : numeric
id : string
kurtosis_shock : numeric
mean_shock : numeric
name : string
port_id : string
positions : numeric
quantity : numeric
reporting_date : numeric
scenario_numbers : numeric
skewness_shock : numeric
std_shock : numeric
timestep_mc : cell
tpt_1 : string
tpt_10 : numeric
tpt_100 : numeric
tpt_1000 : string
tpt_101 : numeric
tpt_102 : numeric
tpt_103 : numeric
tpt_104 : numeric
tpt_105 : numeric
tpt_105a : numeric
tpt_105b : numeric
tpt_106 : numeric
tpt_107 : string
tpt_108 : numeric
tpt_11 : string
tpt_110 : numeric
tpt_111 : numeric
tpt_112 : string
tpt_113 : string
tpt_114 : numeric
tpt_115 : string
tpt_116 : string
tpt_117 : string
tpt_118 : string
tpt_119 : string
tpt_12 : string
tpt_120 : string
tpt_121 : string
tpt_122 : string
tpt_123 : string
tpt_123a : string
tpt_124 : numeric
tpt_125 : numeric
tpt_126 : numeric
tpt_127 : numeric
tpt_128 : numeric
tpt_129 : numeric
tpt_13 : numeric
tpt_130 : numeric
tpt_131 : string
tpt_132 : numeric
tpt_133 : string
tpt_14 : string
tpt_15 : numeric
tpt_16 : string
tpt_17 : string
tpt_17b : string
tpt_18 : numeric
tpt_19 : numeric
tpt_2 : string
tpt_20 : numeric
tpt_21 : string
tpt_22 : numeric
tpt_23 : numeric
tpt_24 : numeric
tpt_25 : numeric
tpt_26 : numeric
tpt_27 : numeric
tpt_28 : numeric
tpt_29 : numeric
tpt_3 : string
tpt_30 : numeric
tpt_31 : numeric
tpt_32 : string
tpt_33 : numeric
tpt_34 : string
tpt_35 : string
tpt_36 : string
tpt_37 : string
tpt_38 : numeric
tpt_39 : string
tpt_4 : string
tpt_40 : string
tpt_41 : numeric
tpt_42 : string
tpt_43 : string
tpt_44 : string
tpt_45 : numeric
tpt_46 : string
tpt_47 : string
tpt_48 : numeric
tpt_49 : string
tpt_5 : numeric
tpt_50 : string
tpt_51 : numeric
tpt_52 : string
tpt_53 : numeric
tpt_54 : string
tpt_55 : string
tpt_56 : string
tpt_57 : string
tpt_58 : string
tpt_58b : string
tpt_59 : numeric
tpt_6 : string
tpt_60 : string
tpt_61 : numeric
tpt_62 : numeric
tpt_63 : string
tpt_64 : string
tpt_65 : string
tpt_67 : string
tpt_68 : string
tpt_69 : numeric
tpt_7 : string
tpt_70 : string
tpt_71 : string
tpt_72 : numeric
tpt_73 : string
tpt_74 : numeric
tpt_75 : numeric
tpt_76 : numeric
tpt_77 : string
tpt_78 : string
tpt_79 : numeric
tpt_8 : numeric
tpt_80 : string
tpt_81 : string
tpt_82 : numeric
tpt_83 : string
tpt_84 : string
tpt_85 : numeric
tpt_86 : string
tpt_87 : numeric
tpt_88 : string
tpt_89 : numeric
tpt_8b : numeric
tpt_9 : numeric
tpt_90 : numeric
tpt_91 : numeric
tpt_92 : numeric
tpt_93 : numeric
tpt_94 : numeric
tpt_94b : numeric
tpt_95 : string
tpt_97 : numeric
tpt_98 : numeric
tpt_99 : numeric
type : string
valuation_date : numeric
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric
var_abs : numeric
var_confidence : numeric
var_positionsum : numeric
varhd_abs : numeric
varhd_rel : numeric
Methods
Position
aggregate
calc_risk
get
getValue
isProp
print_report
set
Parameter
Properties
aggregation_flag : numeric
aggregation_key : cell
archive_flag : numeric
base_currency : string
calc_sm_scr : bool
copulatype : string
description : string
filename_sobol_direction_number : string
first_eval : numeric
folder_archive : string
folder_input : string
folder_mktdata : string
folder_output : string
folder_output_instruments : string
folder_output_mktdata : string
folder_output_positions : string
folder_output_reports : string
folder_output_riskfactors : string
folder_output_stresstests : string
folder_static : string
frob_norm_limit : numeric
id : string
input_filename_corr_matrix : string
input_filename_instruments : string
input_filename_matrix : string
input_filename_mktdata : string
input_filename_positions : string
input_filename_riskfactors : string
input_filename_seed : string
input_filename_stresstests : string
input_filename_surf_stoch : string
input_filename_vola_index : string
input_filename_vola_ir : string
mc : numeric
mc_scen_analysis : numeric
mc_timesteps : cell
name : string
no_stresstests : numeric
nu : numeric
path_archive : string
path_input : string
path_mktdata : string
path_reports : string
path_sobol_direction_number : string
path_static : string
path_working_folder : string
plotting : numeric
quantile : numeric
quantile_bandwidth : numeric
quantile_estimator : string
reporting_date : numeric
rnd_number_gen : string
runcode : string
saving : numeric
scen_number : numeric
scenario_set : cell
sobol_seed : numeric
stable_seed : numeric
timestamp : string
type : string
use_sobol : bool
valuation_date : numeric
Methods
Parameter
get
isProp
set
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
sii_equity_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
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
id : string
name : string
timestep_mc : cell
type : string
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric
Methods
Instrument
del_scen_data
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
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 : numeric
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
cds_initial_premium : numeric
cds_receive_protection : bool
cds_use_initial_premium : bool
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_sliding_term_unit : string
cms_spread : numeric
cms_term : numeric
cms_term_unit : string
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
credit_state : 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
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
fixed_annuity : numeric
fva_type : string
fwd_sliding_term : numeric
fwd_term : numeric
hazard_curve : string
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
loss_given_default : numeric
mac_duration : numeric
maturity_date : string
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_asset : 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
stochastic_zero_base : bool
strike_rate : numeric
sub_type : string
t_degree_freedom : numeric
term : numeric
term_unit : string
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_sliding_term_unit : string
cms_spread : numeric
cms_term : numeric
cms_term_unit : string
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
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
id : string
in_arrears : numeric
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
term_unit : string
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
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
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
duration : numeric
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
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
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
exposure_type : string
foreign_curve : string
id : string
issue_date : string
maturity_date : string
multiplier : numeric
name : string
net_basis : numeric
sii_equity_type : 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 : numeric
cf_dates : numeric
cf_values : numeric
compounding_freq : numeric
compounding_type : string
currency : string
day_count_convention : string
description : string
discount_curve : string
div_yield : numeric
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
exposure_type : string
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
sii_equity_type : 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
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
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
id : string
idio_vola : numeric
model : string
name : string
riskfactors : cell
sensi_cross : numeric
sensi_exponent : numeric
sensi_prefactor : numeric
sensitivities : numeric
shock_type : cell
sii_equity_type : numeric
sub_type : string
timestep_mc : cell
type : string
underlyings : cell
use_taylor_exp : bool
use_value_base : bool
value_base : numeric
value_mc : numeric
value_stress : numeric
x_coord : numeric
y_coord : numeric
z_coord : numeric
Methods
Sensitivity
calc_value
get
set
Stochastic
Properties
asset_class : string
currency : string
description : string
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
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
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
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
term : numeric
term_unit : string
theo_delta : numeric
theo_gamma : numeric
theo_rho : numeric
theo_theta : numeric
theo_vega : numeric
timestep_mc : cell
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
exposure_base : numeric
exposure_mc : numeric
exposure_stress : numeric
id : string
instr_vol_surfaces : cell
instruments : cell
is_basket : bool
name : string
sii_equity_type : numeric
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