У нас должны появиться новые метрики, как их сделать из старых?

|  |
| --- |
| **ForeignExchangeExposure** |
| ParallelDV01 |
| ParallelCS01 |
| ParallelInterestRatesVega1Bp |
| ParallelForeignExchangeVega1Pp |
| **DV01\_buckets** |
| **CS01\_buckets** |
| **InterestRatesVega1Bp\_tenors** |
| **ForeignExchangeVega1Pp\_tenors** |

|  |
| --- |
| * 1. ParallelDV01=ParallelRho/10000 |
| * 1. ParallelCS01=ParallelCreditDelta/10000 |
| * 1. ParallelInterestRatesVega1Bp=ParallelInterestRatesVega/10000 |
| * 1. ParallelForeignExchangeVega1Pp=ParallelForeignExchangeVega/100 |

2.1) DV01\_buckets= Rho/10000 сгруппированное по бакетам 1M, 3M, 6M, 1Y, 18M, 2Y, 3Y, 5Y, 6Y, 7Y, 8Y, 9Y, 10Y, 15Y, >15Y;

Список ДАТ лежит в Model->MarketDataSet->RatesCurvesBundles->нужный индекс (например RUB\_KEY\_RATE)->Dates

Даты превращаются в бакеты группировкой дат по нужным бакетам

<http://fopricing-dev:4004/s/1e721ffe54328a114fcc123c04451f73a4e1191f>

2.2) CS01\_buckets= CreditDelta/10000 сгруппированное по бакетам 1M, 3M, 6M, 1Y, 18M, 2Y, 3Y, 5Y, 6Y, 7Y, 8Y, 9Y, 10Y, 15Y, >15Y;

Список ДАТ лежит в Model->MarketDataSet->CreditCurves ->нужный индекс->Dates

Даты превращаются в бакеты группировкой дат по нужным бакетам

2.3) InterestRatesVega1Bp\_tenors=InterestRatesVega/10000 по тенорам, которые и так есть, они лежат в Model->MarketDataSet->VolatilitySurfaces ->нужный индекс (например RUB\_KEY\_RATE)->Tenors; только InterestRatesVega- это матрица размером tenors\*strikes, и надо матрицу пррсуммирвать вдоль столбцов, и будет массив по тенорам, и поделить на 10000

<http://fopricing-dev:4004/s/9a001a28d20ab8a65a5c329016fa21f1cd64189c>

2.4) ForeignExchangeVega1Pp\_tenors =ForeignExchangeVega/100 по тенорам, которые и так есть, они лежат в Model->MarketDataSet->VolatilitySurfaces ->нужный индекс (например USDRUB)->Tenors; только ForeignExchangeVega – это матрица размеров tenors\*deltas, и из этой матрицы нужно взять столбец ATM и поделить его на 100, и будет ответ

<http://fopricing-dev:4004/s/0b1bbb412ff9eb1bba60df804da3767d69651685>

Те же самые махинации нужно проделать с CVA\_греками, DVA\_греками и BCVA\_греками:

|  |
| --- |
| **CVA\_ForeignExchangeExposure** |
| CVA\_ParallelDV01 |
| CVA\_ParallelCS01 |
| CVA\_ParallelInterestRatesVega1Bp |
| CVA\_ParallelForeignExchangeVega1Pp |
| **CVA\_DV01\_buckets** |
| **CVA\_CS01\_buckets** |
| **CVA\_InterestRatesVega1Bp\_tenors** |
| **CVA\_ForeignExchangeVega1Pp\_tenors** |

|  |
| --- |
| **DVA\_ForeignExchangeExposure** |
| DVA\_ParallelDV01 |
| DVA\_ParallelCS01 |
| DVA\_ParallelInterestRatesVega1Bp |
| DVA\_ParallelForeignExchangeVega1Pp |
| **DVA\_DV01\_buckets** |
| **DVA\_CS01\_buckets** |
| **DVA\_InterestRatesVega1Bp\_tenors** |
| **DVA\_ForeignExchangeVega1Pp\_tenors** |

|  |
| --- |
| **BCVA\_ForeignExchangeExposure** |
| BCVA\_ParallelDV01 |
| BCVA\_ParallelCS01 |
| BCVA\_ParallelInterestRatesVega1Bp |
| BCVA\_ParallelForeignExchangeVega1Pp |
| **BCVA\_DV01\_buckets** |
| **BCVA\_CS01\_buckets** |
| **BCVA\_InterestRatesVega1Bp\_tenors** |
| **BCVA\_ForeignExchangeVega1Pp\_tenors** |