

Предметная область - риск-менеджмент валютной биржи.

По результатам торговых операций в валютах с различных счетов (расчетных кодов) у фирм образуются позиции. Центральному контрагенту необходимо знать, какой риск в рублях он несет по этим позициям.

Описание таблиц.

BANKACC - таблица содержит список расчетных кодов, их тип и принадлежность к фирме

- BANKACCID - идентификатор расчетного кода (счета)
- TYP - тип расчетного кода
- FIRMID - идентификатор фирмы

COLLATERAL - таблица содержит значения залоговых средств в разных валютах

- BANKACCID - идентификатор расчетного кода
- CURRENCYID - идентификатор валюты
- VOLUME - количество валюты на счету

MARKET_RISK - таблица содержит значения риск-параметров по лимитам концентрации

- ASSET - идентификатор актива (валюты)
- LIMIT_CON - нижняя граница диапазона лимита концентрации
- DISCOUNT - ставка дисконтирования в лимите концентрации
- PRICE_CLEAN - цена за единицу актива в рублях

POSITIONS - таблица содержит позиции с различной датой исполнения

- BANKACCID - идентификатор расчетного кода
- CURRENCYID - идентификатор валюты
- SETTLEDATE - дата поставки
- VOLUME - размер позиции