

## PCI ALMレポート情報

### PCI ALM Report Information

2019年5月13日更新

カスタマー・サポート・センターでは、当社経営支援ソリューションをご利用いただいている皆様を対象に、ご運用サポートの一環として毎月PCI ALMレポートを発行しております。直近の金融市況の分析に加え、ALM／リスク管理／収益管理など有益な情報をトピックスとしてご提供しております。

PCI ALMレポートに関するお問合せの際は、下記連絡先までご連絡ください。  
 Profit Cube Inc.カスタマー・サポート・センター TEL: 03-4330-3040

### 最新号・バックナンバー

発行日/号数	内 容
★最新号★ 2019年5月13日発行 (2019年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 拡張VaR、リスクリターンシミュレーション機能 ②</li> </ul>
2019年4月5日発行 (2019年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・LIBOR公表停止に備えて～翌日物金利スワップのご紹介～</li> </ul>
2019年3月7日発行 (2019年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】拡張VaR、リスクリターンシミュレーション機能</li> <li>・スワップションのボラティリティ</li> </ul>
2019年2月7日発行 (2019年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【投資信託のリスク管理】</li> </ul>
2019年2月7日発行 (2019年2月増刊号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・【保存版】IRRBBの報告に向けて</li> </ul>
2019年1月11日発行 (2019年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】仮想明細の利用、登録手順について</li> </ul>
2018年12月7日発行 (2018年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】VaR変動要因(2)</li> <li>・【ALM/リスク管理システム】第7回 ユーザ交流会レポート</li> </ul>
2018年11月7日発行 (2018年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【銀行勘定の金利リスク管理】当局宛報告帳票作成についての注意事項</li> </ul>
2018年10月5日発行 (2018年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】VaR変動要因(1)</li> </ul>
2018年9月7日発行 (2018年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】予算策定の手順および事例紹介</li> <li>・【Vivaldi】東京五輪特別法案に伴う祝祭日の変更対応</li> </ul>
2018年8月7日発行 (2018年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】固定金利貸出の期限前償還を反映させた△EVEの算出手順について</li> <li>・【IRRBB関連お問合せより】△EVE、△NIIの通貨による金利ショックについて</li> </ul>

発行日/号数	内 容
2018年7月6日発行 (2018年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】「銀行勘定の金利リスク」(IRRBB)に係るモニタリング計表作成に関する参考情報について</li> <li>・【Vivaldi】帳票⑥ 感応度分析帳票</li> <li>・【お知らせ】弊社宛に添付ファイル付メールをお送りいただく際のご注意</li> </ul>
2018年6月7日発行 (2018年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】拡張VaR、リスクリターンシミュレーションのエラーについて</li> <li>・【Vivaldi】帳票⑤ 現在価値分析帳票</li> </ul>
2018年5月9日発行 (2018年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】GAP分析機能による金利満期ラダーの出力手順について</li> <li>・【Vivaldi】帳票④ 予測B/S・P/L帳票(3)</li> </ul>
2018年4月6日発行 (2018年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】計画明細の利用について</li> <li>・【Vivaldi】帳票④ 予測B/S・P/L帳票(2)</li> </ul>
2018年3月7日発行 (2018年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】将来時点の△EVE試算手順について</li> <li>・【Vivaldi】帳票④ 予測B/S・P/L帳票(1)</li> </ul>
2018年2月7日発行 (2018年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】時価会計の数値検証手順について</li> <li>・【Vivaldi】帳票③ GAP分析帳票</li> </ul>
2018年1月12日発行 (2018年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】帳票② シナリオ別PV帳票</li> <li>・【Vivaldi】Vivaldi/J-Vivaldiの元号対応について</li> </ul>
2017年12月7日発行 (2017年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】MK003帳票改訂に伴う確認事項について</li> <li>・【ALM/リスク管理システム】第6回 ユーザ交流会レポート</li> <li>・【Vivaldi】帳票① シナリオ市場データ照会</li> </ul>
2017年11月8日発行 (2017年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】第5回 収益管理のデータ集約機能／データ照会機能／帳票出力および帳票の見方</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション⑫ デジタルオプション</li> </ul>
2017年10月6日発行 (2017年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【製品紹介】プリペイメント機能について</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション⑪ コーラブルローン</li> </ul>
2017年9月7日発行 (2017年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】第4回収益管理の仕切金利の計算例②(TP信用コスト・月次運用フロー)</li> <li>・【製品紹介】売買シミュレーション機能について</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション⑩ ターゲットバイニングとカバードコール</li> </ul>
2017年8月7日発行 (2017年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】△EVE、△NII試算手順について</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション⑨ スワップション</li> </ul>
2017年7月7日発行 (2017年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】第3回 収益管理の仕切金利の計算例①</li> <li>・【お知らせ】計画明細の数値確認手順について</li> <li>・【製品紹介】リスク・リターン分析機能について</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション⑧ ブラック・ショールズ式(2)</li> </ul>
2017年6月7日発行 (2017年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【製品紹介】拡張VaR計測機能について</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション⑦ ブラック・ショールズ式(1)</li> <li>・収益管理システム特許取得のお知らせ</li> </ul>
2017年5月10日発行 (2017年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】株VaR算出について</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション⑥ オプションのリスク指標(3) ベガとボラティリティー</li> </ul>

発行日/号数	内 容
2017年4月14日発行 (2017年4月臨時号)	・【保存版】IRRBBIに向けてのシステム対応
2017年4月7日発行 (2017年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】第2回 収益管理を運用するために準備するデータおよびパラメータ類</li> <li>・【製品紹介】IRRBBIに向けてのシステム対応 ～経済価値変動額(ΔEVE)編～</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション⑤ オプションのリスク指標(2) ガンマ</li> </ul>
2017年3月7日発行 (2017年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】システムタブの機能について</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション④ リスク指標(1)</li> </ul>
2017年2月7日発行 (2017年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】収益管理におけるTPと信用コスト</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション③ 本質的価値と時間価値</li> </ul>
2017年1月12日発行 (2017年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・2016年のマーケット振り返り／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】Vivaldiのよくあるご質問&lt;収益シミュレーション(資金シナリオ)の運用&gt;</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション② オプションのペイオフダイアグラム</li> </ul>
2017年1月12日発行 (2017年1月特別号)	・【保存版】Vivaldi／J-Vivaldi よくあるお問い合わせ集
2016年12月7日発行 (2016年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【ALM/リスク管理システム】第5回ユーザー交流会レポート</li> <li>・【ALM基礎知識】オプション① 2項展開モデル</li> </ul>
2016年11月8日発行 (2016年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】Vivaldiのよくあるご質問&lt;残高の不整合&gt;</li> <li>・【ALM基礎知識】約定金利の中にある各部門の利益とリスク分解</li> </ul>
2016年10月7日発行 (2016年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】バックテスト</li> <li>・【ALM基礎知識】約定金利の分解</li> </ul>
2016年9月7日発行 (2016年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】保存・復元機能について</li> <li>・【ALM基礎知識】バックテスト超過</li> </ul>
2016年8月5日発行 (2016年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】Vivaldiのよくあるご質問&lt;データ照会編～第3回～&gt;</li> <li>・【ALM基礎知識】標準偏差と相関係数の活用</li> </ul>
2016年7月7日発行 (2016年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】非線形リスクの把握について</li> <li>・【ALM基礎知識】イールドカーブ変化</li> </ul>
2016年6月20日発行 (2016年6月臨時号)	・【保存版】 パーゼル3「IRRBB 銀行勘定の金利リスク」の最終文書公表
2016年6月17日発行 (2016年6月臨時号)	・【保存版】 MK003帳票の貸出金内訳を細分化する手順について
2016年6月7日発行 (2016年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】 営業店収益管理のPDCAサイクル (まとめ)</li> <li>・【ALM基礎知識】 パーゼル3 「銀行勘定の金利リスク」の最終文書公表</li> </ul>
2016年5月11日発行 (2016年5月特別号)	・【保存版】 収益シミュレーションの概要と操作

発行日/号数	内 容
2016年5月11日発行 (2016年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 Vivaldiのよくあるご質問 &lt;データ照会編～第2回～&gt;</li> <li>・【ALM基礎知識】 金利とPVの関係</li> </ul>
2016年4月7日発行 (2016年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】 予算編2</li> <li>・【ALM基礎知識】 IFRとマイナス金利</li> </ul>
2016年3月7日発行 (2016年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 Vivaldiのよくあるご質問 &lt;データ照会編～第1回～&gt;</li> <li>・【Vivaldi】 マイナス金利を許容したVaR概算値の算出</li> </ul>
2016年2月4日発行 (2016年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】 予算編1</li> <li>・【ALM基礎知識編】 回帰分析2</li> </ul>
2016年1月12日発行 (2016年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 仮想明細機能を用いた投資先の比較検討について</li> <li>・【ALM基礎知識編】 回帰分析1</li> </ul>
2015年12月7日発行 (2015年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 収益シミュレーション</li> <li>・【ALM基礎知識編】 収益率2</li> </ul>
2015年11月9日発行 (2015年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】 実績編 2</li> <li>・【ALM基礎知識】 収益率1</li> </ul>
2015年10月7日発行 (2015年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 金融庁モニタリングレポート:シミュレーション手順について</li> <li>・【ALM基礎知識】 密度分布関数と累積分布関数について</li> </ul>
2015年9月7日発行 (2015年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 収益シミュレーション</li> <li>・【ALM基礎知識】 相関係数・共分散について</li> </ul>
2015年8月7日発行 (2015年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】 実績編1</li> <li>・【ALM基礎知識】 正規分布について</li> </ul>
2015年7月7日発行 (2015年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 収益シミュレーション</li> <li>・【ALM基礎知識】 標準偏差について</li> </ul>
2015年6月4日発行 (2015年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】 資金利益計算の仕組</li> </ul>
2015年5月12日発行 (2015年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 よくあるご質問 集計区分について</li> <li>・【Vivaldi】 バックアップの必要性について</li> </ul>
2015年4月7日発行 (2015年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 金利に関するQ&amp;A</li> </ul>
2015年3月5日発行 (2015年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【収益管理】 営業店収益管理のPDCAサイクル</li> </ul>
2015年2月6日発行 (2015年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【ALM概要】 勘定科目の新規追加に伴う操作手順</li> </ul>
2015年1月9日発行 (2015年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【ALM概要】 デュレーション分析</li> </ul>

発行日/号数	内 容
2014年12月5日発行 (2014年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【Vivaldi】 Vivaldiのよくあるご質問 &lt;データ取込編②&gt;</li> </ul>
2014年11月10日発行 (2014年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【ALM概要】 収益性とリスク - RAROC 2</li> </ul>
2014年10月7日発行 (2014年10月特別号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・【保存版】 Bralms・B-VaR機能の活用</li> </ul>
2014年10月7日発行 (2014年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・Vivaldiのよくあるご質問(データ取込編①)</li> </ul>
2014年9月5日発行 (2014年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・【ALM概要】 収益性とリスク - RAROC 1</li> </ul>
2014年8月15日発行 (2014年8月特別号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・【保存版】 Vivaldi仕組商品の概要と登録操作</li> </ul>
2014年8月7日発行 (2014年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ Bralmsの機能 集計区分と集計期間</li> </ul>
2014年7月7日発行 (2014年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・仕組商品(7) コーラブル債</li> <li>・Vivaldiの機能 コーラブル債の登録方法について</li> </ul>
2014年6月6日発行 (2014年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・仕組商品(6) パワーリバースデュアル債</li> <li>・Vivaldiの機能 パワーリバースデュアル債の登録方法について</li> </ul>
2014年5月9日発行 (2014年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・仕組商品(5) リバースデュアルカレンシー債</li> <li>・Vivaldiの機能 リバースデュアルカレンシー債の登録方法について</li> </ul>
2014年4月7日発行 (2014年4月特別号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・【保存版】 Bralms・B-VaR運用上の注意事項</li> </ul>
2014年4月8日発行 (2014年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・仕組商品(4) デュアルカレンシー債</li> <li>・Vivaldiの機能 デュアルカレンシー債の登録方法について</li> </ul>
2014年3月7日発行 (2014年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・仕組商品(3) CMS債</li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 【Vivaldi】 CMS債の登録方法について 【Bralms】 シナリオイールドについて</li> </ul>
2014年2月7日発行 (2014年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・仕組商品(2) ステップアップ</li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 【Vivaldi】 ステップアップの登録方法について 【Bralms】 標準偏差の概算方法について</li> </ul>

発行日/号数	内 容
2014年1月10日発行 (2014年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・仕組商品(1) リバースフローター</li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi】 リバースフローターの登録方法とシステム内での取扱いについて</li> <li>【Bralms】 コリレーションVaRの変動要因分析に使用するデータについて</li> </ul> </li> </ul>
2013年12月5日発行 (2013年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・市場乱高下のバックテストへの影響</li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi】 バックテスト機能と特定観測期間のVaR計測について</li> <li>【Bralms】 収益シミュレーションの利回り変動要因について</li> </ul> </li> <li>・TIBOR公表期間の見直しに関して</li> </ul>
2013年11月8日発行 (2013年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・流動性リスク <ul style="list-style-type: none"> <li>流動性リスク管理の状況とLOR</li> </ul> </li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi】 リスクシナリオ設定手順について</li> <li>【Bralms】 帳表の基本的な仕組みと処理結果データの読み方について</li> </ul> </li> </ul>
2013年10月7日発行 (2013年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・流動性リスク <ul style="list-style-type: none"> <li>資金繰りリスクと市場流動性リスク</li> </ul> </li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi】 勘定科目単位の資金シナリオ作成について</li> <li>【Bralms】 既存の登録内容をベースにデータを編集・新規登録する方法について</li> </ul> </li> </ul>
2013年9月6日発行 (2013年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・金利変化とデュレーション・コンベクシティ分析 <ul style="list-style-type: none"> <li>ポートフォリオ運用におけるデュレーションとコンベクシティの活用</li> </ul> </li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi】 大科目単位の資金シナリオ作成について</li> <li>【Bralms】 特定の商品についてシミュレーションする手順について</li> </ul> </li> </ul>
2013年8月7日発行 (2013年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・金利変化とデュレーション・コンベクシティ分析 <ul style="list-style-type: none"> <li>デュレーション、コンベクシティによるポートフォリオ価値や収益性の分析</li> </ul> </li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi】 株式と仕組商品のリスクファクターについて</li> <li>【Bralms】 大科目について</li> </ul> </li> </ul>
2013年7月5日発行 (2013年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・LIBOR公表停止に伴う注意事項 <ul style="list-style-type: none"> <li>基準金利のパラメータ変更に関する補足事項</li> </ul> </li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 各種データの取り込み-3 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi】、【Bralms】 分析に用いる金利データの関係</li> </ul> </li> </ul>
2013年6月7日発行 (2013年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・LIBOR公表停止に伴う注意事項 <ul style="list-style-type: none"> <li>パラメータ変更に関するFAQ</li> </ul> </li> <li>・VivaldiとBralmsの機能 各種データの取り込み-2 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi】 勘定科目紐付機能、基本情報紐付機能について</li> <li>【Bralms】 キー変換機能について</li> </ul> </li> </ul>
2013年5月13日発行 (2013年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・LIBOR公表停止に伴う注意事項</li> <li>・VivaldiとBralmsの機能比較 <ul style="list-style-type: none"> <li>【Vivaldi・Bralms】 各種データの取り込み-1 銘柄情報や明細データの取り込み</li> </ul> </li> </ul>
2013年4月26日発行 (2013年4月臨時号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・LIBOR公表停止に伴う注意事項 <ul style="list-style-type: none"> <li>Vivaldiでの対応、Bralmsでの対応</li> </ul> </li> </ul>



発行日/号数	内 容
2013年4月5日発行 (2013年4月号※) <small>※号数を発行月に合わせた振り方に変更しました。2013年2月号の翌月号となります。</small>	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・LIBOR公表停止に伴う注意事項</li> <li>・収益管理システムProfit運用の注意事項 【Profit】 管理会計を目的としたデータ作成</li> <li>・VivaldiとBralmsの機能比較 Vivaldi・Bralms機能概要の比較</li> <li>・比較的多かったお問い合わせについて</li> </ul>
2013年3月7日発行 (2013年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・金利上昇による資金利益とPV</li> <li>・収益管理システムProfit運用の注意事項 【Profit】 管理会計を目的としたデータ作成</li> <li>・LIBOR公表停止に伴う注意事項</li> </ul>
2013年2月8日発行 (2013年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・VaR値差異要因</li> <li>・収益管理システムProfit運用の注意事項 【Profit】 各種出力帳表について</li> <li>・VivaldiとBralmsの機能比較 【Vivaldi・Bralms】 保存・復元機能、基準日設定について</li> </ul>
2013年1月11日発行 (2012年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・将来のリスク／リターン分析</li> <li>・収益管理システムProfit運用の注意事項 【Profit】各種計数照会機能について</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項 【B-VaR】 バックテストについて</li> </ul>
2012年12月6日発行 (2012年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・期待ショートフォール</li> <li>・収益管理システムProfit運用の注意事項 【Profit】 財務会計と管理会計の差異について-2</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項 【B-VaR】、【Vivaldi】 VaR計測およびVaR計測パラメータについて</li> </ul>
2012年11月7日発行 (2012年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・市場データの<math>\chi^2</math>乗検定</li> <li>・収益管理システムProfit運用の注意事項 【Profit】 財務会計と管理会計の差異について</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項 【B-VaR】 VaR算出基準日設定、リスクファクター算出、感応度データ算出について 【Vivaldi】 リスクファクターについて</li> </ul>
2012年10月10日発行 (2012年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・将来のポートフォリオ価値の変動リスク</li> <li>・収益管理システム運用上の注意事項-3 【Profit】 予算と実績のデータ保存/復元について</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-9 【Bralms】 データ保存/復元について</li> </ul>
2012年9月7日発行 (2012年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ALMシステムの帳表-6 MW法と<math>\sqrt{t}</math>倍法</li> <li>・収益管理システム運用上の注意事項-2 【Profit】 個別採算管理システムについて</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-8 【Bralms】 収益シミュレーションについて</li> </ul>
2012年8月7日発行 (2012年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ALMシステムの帳表-5 VaR計測とバックテスト</li> <li>・収益管理システム運用上の注意事項-1 【Profit】 変動金利商品の各種パラメータ設定について</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-7 【Bralms】 資金計画値作成について</li> <li>・パーゼルⅢの流動性リスクについて</li> </ul>

発行日/号数	内 容
2012年7月6日発行 (2012年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ALMシステムの帳表-4 期間損益分析とPV分析 アプローチ比較</li> <li>・収益管理システムで取扱う固有のデータ</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-6</li> <li>【Bralms】 基準金利登録、金利シナリオ登録、金利パラメータについて</li> </ul>
2012年6月7日発行 (2012年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ALMシステムの帳表-3 市場金利と基準金利/金利シナリオの比較</li> <li>・資金利益予算の策定-3</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-5</li> <li>【Bralms】 シナリオイールド別NPV表、金利感応分析表、グリッドセンシビリティ表について</li> </ul>
2012年5月9日発行 (2012年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ALMシステムの帳表-2 ギャップ分析と金利感応度分析の比較</li> <li>・資金利益予算の策定-2</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-4</li> <li>【Bralms】 オンバランス現在価値算出、ギャップ分析について</li> </ul>
2012年4月6日発行 (2012年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ALMシステムの帳表 -1 グリッドセンシビリティ表</li> <li>・資金利益予算の策定 -1</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-3</li> <li>【Bralms】 キャッシュフロー作成、市場金利取込、シナリオイールド登録について</li> </ul>
2012年3月7日発行 (2012年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・異なるイールド間のスプレッドリスク</li> <li>・TP計算を使った営業店の業績評価</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-2</li> <li>【Bralms】 データ取込、ラダー作成について</li> </ul>
2012年2月8日発行 (2012年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・異なるイールドカーブによる現在価値の差</li> <li>・収益管理におけるTP、スプレッドの実績計算の仕組み</li> <li>・ALMシステム運用上の注意事項-1</li> <li>【Bralms】 ログイン、基準日設定について</li> </ul>
2012年1月16日発行 (2011年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・リバースストレス</li> <li>・収益管理システムにおける資金利益計算の概要</li> </ul>
2011年12月8日発行 (2011年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ストレステスト-2 ～ストレスVaR～</li> </ul>
2011年11月10日発行 (2011年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・ストレステスト-1 ～ストレスシナリオ～</li> </ul>
2011年10月11日発行 (2011年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・99%タイルによる金利ショック値-2</li> </ul>
2011年9月12日発行 (2011年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> <li>・当月のマーケット概要／市場データ分析</li> <li>・日銀/金融庁/その他規制</li> <li>・99%タイルによる金利ショック値-1</li> </ul>