

PCI ALMレポート情報

PCI ALM Report Information

2018年12月7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★ 2018年12月7日発行 (2018年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【Vivaldi】VaR変動要因(2) ・【ALM/リスク管理システム】第7回 ユーザ交流会レポート
2018年11月7日発行 (2018年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【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
2018年10月5日発行 (2018年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【Vivaldi】VaR変動要因(1)
2018年9月7日発行 (2018年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【収益管理】予算策定の手順および事例紹介 ・【Vivaldi】東京五輪特別法案に伴う祝祭日の変更対応
2018年8月7日発行 (2018年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【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 ・【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
2018年7月6日発行 (2018年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【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 ・【Vivaldi】帳票⑥ 感応度分析帳票 ・【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
2018年6月7日発行 (2018年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【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 ・【Vivaldi】帳票⑤ 現在価値分析帳票
2018年5月9日発行 (2018年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【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 ・【Vivaldi】帳票④ 予測B/S・P/L帳票(3)
2018年4月6日発行 (2018年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【Vivaldi】計画明細の利用について ・【Vivaldi】帳票④ 予測B/S・P/L帳票(2)
2018年3月7日発行 (2018年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【Vivaldi】将来時点の△EVE試算手順について ・【Vivaldi】帳票④ 予測B/S・P/L帳票(1)
2018年2月7日発行 (2018年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要/市場データ分析 ・【Vivaldi】時価会計の数値検証手順について ・【Vivaldi】帳票③ GAP分析帳票

発行日/号数	内 容
2018年1月12日発行 (2018年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】帳票② シナリオ別PV帳票 ・【Vivaldi】Vivaldi/J-Vivaldiの元号対応について
2017年12月7日発行 (2017年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】MK003帳票改訂に伴う確認事項について ・【ALM/リスク管理システム】第6回 ユーザ交流会レポート ・【Vivaldi】帳票① シナリオ市場データ照会
2017年11月8日発行 (2017年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【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 ・【ALM基礎知識】オプション⑫ デジタルオプション
2017年10月6日発行 (2017年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【製品紹介】プリペイメント機能について ・【ALM基礎知識】オプション⑪ コーラブルローン
2017年9月7日発行 (2017年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【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) ・【製品紹介】売買シミュレーション機能について ・【ALM基礎知識】オプション⑩ ターゲットバイングとカバードコール
2017年8月7日発行 (2017年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】△EVE、△NI試算手順について ・【ALM基礎知識】オプション⑨ スワップション
2017年7月7日発行 (2017年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】第3回 収益管理の仕切金利の計算例① ・【お知らせ】計画明細の数値確認手順について ・【製品紹介】リスク・リターン分析機能について ・【ALM基礎知識】オプション⑧ ブラック・ショールズ式(2)
2017年6月7日発行 (2017年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【製品紹介】拡張VaR計測機能について ・【ALM基礎知識】オプション⑦ ブラック・ショールズ式(1) ・収益管理システム特許取得のお知らせ
2017年5月10日発行 (2017年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】株VaR算出について ・【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
2017年4月14日発行 (2017年4月臨時号)	<ul style="list-style-type: none"> ・【保存版】IRRBB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"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【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 ・【製品紹介】IRRBBに向けてのシステム対応 ～経済価値変動額(△EVE)編～ ・【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
2017年3月7日発行 (2017年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】システムタブの機能について ・【ALM基礎知識】オプション④ リスク指標(1)
2017年2月7日発行 (2017年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】収益管理におけるTPと信用コスト ・【ALM基礎知識】オプション③ 本質的価値と時間価値
2017年1月12日発行 (2017年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・2016年のマーケット振り返り／市場データ分析 ・【Vivaldi】Vivaldiのよくあるご質問<収益シミュレーション(資金シナリオ)の運用> ・【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
2017年1月12日発行 (2017年1月特別号)	<ul style="list-style-type: none"> ・【保存版】Vivaldi/J-Vivaldi よくあるお問い合わせ集

発行日/号数	内 容
2016年12月7日発行 (2016年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【ALM/リスク管理システム】第5回ユーザー交流会レポート ・【ALM基礎知識】オプション① 2項展開モデル
2016年11月8日発行 (2016年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】Vivaldiのよくあるご質問＜残高の不整合＞ ・【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
2016年10月7日発行 (2016年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】バックテスト ・【ALM基礎知識】約定金利の分解
2016年9月7日発行 (2016年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】保存・復元機能について ・【ALM基礎知識】バックテスト超過
2016年8月5日発行 (2016年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】Vivaldiのよくあるご質問＜データ照会編～第3回～＞ ・【ALM基礎知識】標準偏差と相関係数の活用
2016年7月7日発行 (2016年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】非線形リスクの把握について ・【ALM基礎知識】イールドカーブ変化
2016年6月20日発行 (2016年6月臨時号)	<ul style="list-style-type: none"> ・【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)	<ul style="list-style-type: none"> ・【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"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】 営業店収益管理のPDCAサイクル（まとめ） ・【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
2016年5月11日発行 (2016年5月特別号)	<ul style="list-style-type: none"> ・【保存版】 収益シミュレーションの概要と操作
2016年5月11日発行 (2016年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】 Vivaldiのよくあるご質問 ＜データ照会編～第2回～＞ ・【ALM基礎知識】 金利とPVの関係
2016年4月7日発行 (2016年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】 予算編2 ・【ALM基礎知識】 IFRとマイナス金利
2016年3月7日発行 (2016年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】 Vivaldiのよくあるご質問 ＜データ照会編～第1回～＞ ・【Vivaldi】 マイナス金利を許容したVaR概算値の算出
2016年2月4日発行 (2016年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】 予算編1 ・【ALM基礎知識編】 回帰分析2
2016年1月12日発行 (2016年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】 仮想明細機能を用いた投資先の比較検討について ・【ALM基礎知識編】 回帰分析1
2015年12月7日発行 (2015年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】 収益シミュレーション ・【ALM基礎知識編】 収益率2

発行日/号数	内 容
2015年11月9日発行 (2015年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】実績編 2 ・【ALM基礎知識】収益率1
2015年10月7日発行 (2015年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【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 ・【ALM基礎知識】密度分布関数と累積分布関数について
2015年9月7日発行 (2015年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】収益シミュレーション ・【ALM基礎知識】相関係数・共分散について
2015年8月7日発行 (2015年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】実績編1 ・【ALM基礎知識】正規分布について
2015年7月7日発行 (2015年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】収益シミュレーション ・【ALM基礎知識】標準偏差について
2015年6月4日発行 (2015年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】資金利益計算の仕組
2015年5月12日発行 (2015年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】よくあるご質問 集計区分について ・【Vivaldi】バックアップの必要性について
2015年4月7日発行 (2015年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】金利に関するQ&A
2015年3月5日発行 (2015年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】営業店収益管理のPDCAサイクル
2015年2月6日発行 (2015年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【ALM概要】勘定科目の新規追加に伴う操作手順
2015年1月9日発行 (2015年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【ALM概要】デュレーション分析
2014年12月5日発行 (2014年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】Vivaldiのよくあるご質問 <データ取込編②>
2014年11月10日発行 (2014年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【ALM概要】収益性とリスク - RAROC 2
2014年10月7日発行 (2014年10月特別号)	<ul style="list-style-type: none"> ・【保存版】Bralms・B-VaR機能の活用
2014年10月7日発行 (2014年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・Vivaldiのよくあるご質問(データ取込編①)
2014年9月5日発行 (2014年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【ALM概要】収益性とリスク - RAROC 1
2014年8月15日発行 (2014年8月特別号)	<ul style="list-style-type: none"> ・【保存版】Vivaldi仕組商品の概要と登録操作

発行日/号数	内 容
2014年8月7日発行 (2014年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・Bralmsの機能 集計区分と集計期間
2014年7月7日発行 (2014年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・仕組商品(7) コーラブル債 ・Vivaldiの機能 コーラブル債の登録方法について
2014年6月6日発行 (2014年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・仕組商品(6) パワーリバースデュアル債 ・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
2014年5月9日発行 (2014年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・仕組商品(5) リバースデュアルカレンシー債 ・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
2014年4月7日発行 (2014年4月特別号)	<ul style="list-style-type: none"> ・【保存版】 Bralms・B-VaR運用上の注意事項
2014年4月8日発行 (2014年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・仕組商品(4) デュアルカレンシー債 ・Vivaldiの機能 デュアルカレンシー債の登録方法について
2014年3月7日発行 (2014年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・仕組商品(3) CMS債 ・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
2014年2月7日発行 (2014年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・仕組商品(2) ステップアップ ・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
2014年1月10日発行 (2014年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・仕組商品(1) リバースフローター ・VivaldiとBralmsの機能 【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 【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
2013年12月5日発行 (2013年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・市場乱高下のバックテストへの影響 ・VivaldiとBralmsの機能 【Vivaldi】 バックテスト機能と特定観測期間のVaR計測について 【Bralms】 収益シミュレーションの利回り変動要因について ・TIBOR公表期間の見直しに関して
2013年11月8日発行 (2013年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・流動性リスク 流動性リスク管理の状況とLOR ・VivaldiとBralmsの機能 【Vivaldi】 リスクシナリオ設定手順について 【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

発行日/号数	内 容
2013年10月7日発行 (2013年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・流動性リスク ・資金繰りリスクと市場流動性リスク ・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> 【Vivaldi】 勘定科目単位の資金シナリオ作成について 【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
2013年9月6日発行 (2013年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・金利変化とデュレーション・コンベクシティ分析 ・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 ・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> 【Vivaldi】 大科目単位の資金シナリオ作成について 【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
2013年8月7日発行 (2013年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・金利変化とデュレーション・コンベクシティ分析 ・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 ・VivaldiとBralmsの機能 <ul style="list-style-type: none"> 【Vivaldi】 株式と仕組商品のリスクファクターについて 【Bralms】 大科目について
2013年7月5日発行 (2013年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・LIBOR公表停止に伴う注意事項 ・基準金利のパラメータ変更に関する補足事項 ・VivaldiとBralmsの機能 各種データの取り込み-3 【Vivaldi】、【Bralms】 分析に用いる金利データの関係
2013年6月7日発行 (2013年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・LIBOR公表停止に伴う注意事項 ・パラメータ変更に関するFAQ ・VivaldiとBralmsの機能 各種データの取り込み-2 【Vivaldi】 勘定科目紐付機能、基本情報紐付機能について 【Bralms】 キー変換機能について
2013年5月13日発行 (2013年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・LIBOR公表停止に伴う注意事項 ・VivaldiとBralmsの機能比較 【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
2013年4月26日発行 (2013年4月臨時号)	<ul style="list-style-type: none"> ・LIBOR公表停止に伴う注意事項 Vivaldiでの対応、Bralmsでの対応
2013年4月5日発行 (2013年4月号※) ※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。	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・LIBOR公表停止に伴う注意事項 ・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 ・VivaldiとBralmsの機能比較 Vivaldi・Bralms機能概要の比較 ・比較的多かったお問い合わせについて
2013年3月7日発行 (2013年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・金利上昇による資金利益とPV ・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 ・LIBOR公表停止に伴う注意事項
2013年2月8日発行 (2013年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・VaR値差異要因 ・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 ・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

発行日/号数	内 容
2013年1月11日発行 (2012年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・将来のリスク／リターン分析 ・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 ・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
2012年12月6日発行 (2012年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・期待ショートフォール ・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 ・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
2012年11月7日発行 (2012年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・市場データのχ^2乗検定 ・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 ・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
2012年10月10日発行 (2012年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・将来のポートフォリオ価値の変動リスク ・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 ・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
2012年9月7日発行 (2012年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・ALMシステムの帳表-6 MW法と\sqrt{t}倍法 ・収益管理システム運用上の注意事項-2 【Profit】 個社別採算管理システムについて ・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
2012年8月7日発行 (2012年7月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・ALMシステムの帳表-5 VaR計測とバックテスト ・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 ・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 ・パーゼル皿の流動性リスクについて
2012年7月6日発行 (2012年6月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・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 ・収益管理システムで取扱う固有のデータ ・ALMシステム運用上の注意事項-6 【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
2012年6月7日発行 (2012年5月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・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 ・資金利益予算の策定-3 ・ALMシステム運用上の注意事項-5 【Bralms】 シナリオイールド別NPV表、金利感応分析表、グリッドセンシティブリティ表について
2012年5月9日発行 (2012年4月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・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 ・資金利益予算の策定-2 ・ALMシステム運用上の注意事項-4 【Bralms】 オンバランス現在価値算出、ギャップ分析について

発行日/号数	内 容
2012年4月6日発行 (2012年3月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・ALMシステムの帳表 -1 グリッドセンシティブリティ表 ・資金利益予算の策定 -1 ・ALMシステム運用上の注意事項-3 【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
2012年3月7日発行 (2012年2月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・異なるイールド間のスプレッドリスク ・TP計算を使った営業店の業績評価 ・ALMシステム運用上の注意事項-2 【Bralms】 データ取込、ラダー作成について
2012年2月8日発行 (2012年1月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・異なるイールドカーブによる現在価値の差 ・収益管理におけるTP、スプレッドの実績計算の仕組み ・ALMシステム運用上の注意事項-1 【Bralms】 ログイン、基準日設定について
2012年1月16日発行 (2011年12月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・リバースストレス ・収益管理システムにおける資金利益計算の概要
2011年12月8日発行 (2011年11月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・ストレステスト-2 ～ストレスVaR～
2011年11月10日発行 (2011年10月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・ストレステスト-1 ～ストレスシナリオ～
2011年10月11日発行 (2011年9月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・99%タイルによる金利ショック値-2
2011年9月12日発行 (2011年8月号)	<ul style="list-style-type: none"> ・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・日銀/金融庁/その他規制 ・99%タイルによる金利ショック値-1