

PCIレポート情報

Profit Cube Inc.Report Information

2025年8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(Profit Cube Inc.)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。
プロフィットキューブ株式会社 カスタマー・サポート・センター TEL:050-1707-2853

最新号・バックナンバー

発行日/号数	内 容
★最新号★ 2025年8月7日発行 (2025年8月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・コラム:FRB議長と日銀総裁あれこれ ・一口エッセイ:イーロン・マスク氏が考えている未来
2025年7月7日発行 (2025年7月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2025年6月6日発行 (2025年6月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2025年5月9日発行 (2025年5月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】IRRBB金利ショック幅の改訂について ※2024年8月号のトピックスに「変動幅変更後の試算手順」追記
2025年4月7日発行 (2025年4月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】予算関連のトピックス掲載号のご紹介 ・【保存版】収益管理機能(予算編)
2025年3月7日発行 (2025年3月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2025年2月7日発行 (2025年2月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2025年1月10日発行 (2025年1月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2024年12月12日発行 (2024年12月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析

発行日/号数	内 容
2024年11月8日発行 (2024年11月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】オプション機能について
2024年10月8日発行 (2024年10月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2024年9月6日発行 (2024年9月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】外貨建取引の収益シミュレーションについて
2024年8月7日発行 (2024年8月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】IRRBB金利ショック幅の改訂について ・【Vivaldi】第10回Vivaldi/J-Vivaldiユーザー交流会レポート
2024年7月5日発行 (2024年7月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2024年6月7日発行 (2024年6月号)	・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の資金シナリオ例
2024年5月9日発行 (2024年5月号)	・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の市場シナリオ例
2024年4月5日発行 (2024年4月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2024年3月7日発行 (2024年3月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2024年2月7日発行 (2024年2月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2024年1月12日発行 (2024年1月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2023年12月7日発行 (2023年12月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析

発行日/号数	内 容
2023年11月8日発行 (2023年11月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2023年10月6日発行 (2023年10月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【リスク管理】「オペレーショナル・リスク管理に関するアンケート」の集計結果について
2023年9月7日発行 (2023年9月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】スワップション等のボラティリティデータについて
2023年8月7日発行 (2023年8月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】通常運用管理について
2023年7月7日発行 (2023年7月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2023年6月7日発行 (2023年6月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析
2023年5月10日発行 (2023年5月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】Vivaldiの基本操作について ・【Vivaldi】ISDN回線のINSサービス終了について
2023年4月7日発行 (2023年4月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】ポートフォリオ変更による金利VaR変化の留意点について
2023年3月7日発行 (2023年3月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】勘定科目を追加した場合に必要なパラメータ設定について(収益管理編)
2023年2月7日発行 (2023年2月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】VaRバックテスト実損益の計算について
2023年1月12日発行 (2023年1月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】第9回 Vivaldi/J-Vivaldiユーザー交流会レポート
2022年12月7日発行 (2022年12月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】基本操作時の注意点

発行日/号数	内 容
2022年11月8日発行 (2022年11月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】大科目比率設定・大科目シナリオ登録について
2022年10月7日発行 (2022年10月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】期の途中で予算を作成する場合の手順と留意点について
2022年9月7日発行 (2022年9月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】金利上昇局面での収益管理運用について
2022年8月5日発行 (2022年8月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】仮想明細・計画明細を使用している場合のOISへの切替について
2022年7月7日発行 (2022年7月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】LIBOR代替指標金利への移行に伴う留意事項(収益管理編)
2022年6月7日発行 (2022年6月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】帳票の数値の根拠を確認する方法(収益管理:予算編)
2022年5月11日発行 (2022年5月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】帳票の数値の根拠を確認する方法(収益管理:実績編)
2022年4月7日発行 (2022年4月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】帳票の数値の根拠を確認する方法(収益SIM編)
2022年3月7日発行 (2022年3月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】帳票の数値の根拠を確認する方法について(VaR編 -VaR要因分析機能-)
2022年2月7日発行 (2022年2月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】帳票の数値の根拠を確認する方法について(PV編)
2022年1月28日発行 (2022年1月特別号)	・【保存版】LIBOR廃止対応について
2022年1月12日発行 (2022年1月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】OIS金利への移行に伴う留意事項

発行日/号数	内 容
2021年12月7日発行 (2021年12月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】OISの登録方法について-時価会計編- ・【Vivaldi】OIS金利に変更後の再処理について ・【Vivaldi】OISとVaRバックテスト ・【Vivaldi】OISと日月連携
2021年11月8日発行 (2021年11月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】VivaldiにおけるOIS後決め金利への対応 ・【Vivaldi】IE11のサポート終了に伴うVivaldiの稼働環境について
2021年10月7日発行 (2021年10月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】収益管理システムでよくあるエラーとその対処法について
2021年9月7日発行 (2021年9月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】LIBORの公表停止に伴う新しいイールドカーブのご提案 ・【Vivaldi】v-Analysisで収益SIM結果を確認する方法について
2021年8月6日発行 (2021年8月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【収益管理】年度の変わり目における各種パラメータの見直しについて
2021年7月7日発行 (2021年7月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】エラー発生時のお問い合わせに関する手順・方法について
2021年6月7日発行 (2021年6月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】LIBORの公表停止に関する最新情報 ・【Vivaldi】Internet Explorer11のサポート終了に伴うVivaldiの今後の対応
2021年5月12日発行 (2021年5月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】v-Analysisを用いたIRRBB検証事例
2021年4月7日発行 (2021年4月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】v-Analysis キューブデータ削除手順
2021年3月5日発行 (2021年3月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】LIBORの恒久的な公表停止に備えた対応について ～Vivaldiでの実務面から～
2021年2月5日発行 (2021年2月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】v-Analysisの活用事例について_2
2021年1月12日発行 (2021年1月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】v-Analysisの活用事例について
2020年12月7日発行 (2020年12月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】期末に多いお問い合わせのご紹介 ・【Vivaldi】再掲:東京五輪延期に伴う2021年祝祭日の変更について
2020年11月6日発行 (2020年11月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】計画明細で株式の売却を登録する方法について
2020年10月7日発行 (2020年10月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】OIS変更後のVaRへの影響について
2020年9月7日発行 (2020年9月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】OIS変更後のΔEVE/ΔNIIへの影響について

発行日/号数	内 容
2020年8月7日発行 (2020年8月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】新型コロナウイルス感染症特別貸付の取り扱いについて ・【Vivaldi】OISの登録方法について
2020年7月7日発行 (2020年7月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】ファンドの取り扱いについて
2020年6月5日発行 (2020年6月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】東京五輪延期に伴う2021年祝祭日の変更について ・【Vivaldi】Vivaldiで予算を作る(ボトムアップ予算)
2020年5月12日発行 (2020年5月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】新型コロナウイルスショックの市場への影響
2020年4月7日発行 (2020年4月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】Vivaldiで予算を作る(トップダウン予算)
2020年3月6日発行 (2020年3月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・第8回 Vivaldi/J-Vivaldiユーザー交流会レポート
2020年2月7日発行 (2020年2月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】通貨を増やした際に、IRRBB計表作成に必要な設定・操作について
2020年1月10日発行 (2020年1月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】IRRBB機能:データ検索ツール
2019年12月6日発行 (2019年12月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】IRRBB計表改訂対応に関する検討事項 3:チェックツール関連
2019年11月8日発行 (2019年11月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】IRRBB計表改訂対応に関する検討事項 2:MK024-025
2019年10月7日発行 (2019年10月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】IRRBB計表改訂対応に関する検討事項 1:MK003
2019年9月6日発行 (2019年9月号)	・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精緻化のためのスプレッド機能②
2019年8月7日発行 (2019年8月号)	・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精緻化のためのスプレッド機能①
2019年7月5日発行 (2019年7月号)	・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 FAQ集
2019年6月7日発行 (2019年6月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】MK024-025報告計表(2019年9月基準)の改訂について ・【Vivaldi】TIBOR2M廃止に伴う対応について
2019年5月13日発行 (2019年5月号)	・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機能 ②
2019年4月5日発行 (2019年4月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・LIBOR公表停止に備えて～翌日物金利スワップのご紹介～

発行日/号数	内 容
2019年3月7日発行 (2019年3月号)	・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機能 ・スワップションのボラティリティ
2019年2月7日発行 (2019年2月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【投資信託のリスク管理】
2019年2月7日発行 (2019年2月増刊号)	・【保存版】IRRBBの報告に向けて
2019年1月11日発行 (2019年1月号)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】仮想明細の利用、登録手順について
2018年12月7日発行 (2018年12月号)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・当月のマーケット概要／市場データ分析 ・【Vivaldi】△EVE、△NIⅡ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)	・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)	・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)	・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)	・【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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・【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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・【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)	・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)	・【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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・【保存版】Bralms・B-VaR機能の活用
2014年10月7日発行 (2014年10月号)	・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)	・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)	・【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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・【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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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 【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)	・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 【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)	・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 【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)	・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)	・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)	・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)	・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※) ※号数を発行月にあわせた振り 方に変更しました。2013年2月号 の翌月号となります。	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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 ・バーゼルⅢの流動性リスクについて
2012年7月6日発行 (2012年6月号)	・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)	・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)	・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)	・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 グリッドセンシビリティ表 ・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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)	・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