

ARECCIA. AxCoreの主な機能

分類	項目	説明
取引情報管理	時価評価	各対応金融商品の公正価値を算出。対象商品全体の一括時価評価も可能です。
	取引情報操作	各取引の情報を登録・更新・削除・参照出来ます。
	キャッシュフロー生成・編集	銘柄属性情報を基に個別キャッシュフローを自動生成します。生成後の個別編集も可能です。
	契約属性管理	取引相手先、ギャランター、社内部門・担当者、決済口座、個別担保、解約清算金等の情報を管理します。
期日管理	権利行使管理	オプション権利の行使済・放棄ステータス等を管理します。
	受払管理	受払済のステータス（受払利息、オプションプレミアム、解約清算金）等を管理します。
	値決め管理	個別値決め、一括自動値決め、値決め済ステータス情報等を管理します。
	変動指数値決め予定管理	変動金利等の値決め予定を管理します。
	ロールバック	評価日を過去に移動することにより、過去のポートフォリオの状況を閲覧します。
リスク管理	未収未払金計測	特定期間の未収未払い情報を計測します。
	期間損益計測	特定期間の期間損益を計測します。
	金利グリッド感応度計測	金利グリッド感応度と、感応度の変化を計測します（金利デルタ/ガンマ相当額として利用可能です）。
	タイムデイクイ計測	評価日を1日シフトして経時変化を計測します（セータ相当額として利用可能です）。
	ボラティリティ・グリッド感応度計測	ボラティリティ・グリッドの感応度を計測します（ベガ相当額として利用可能です）。
	価格グリッド感応度計測	価格グリッド感応度を計測します（価格デルタ相当額として利用可能）。
	カレントエクスポージャ計測	バーゼル形式でのカレントエクスポージャを計測します。
	VaR計測	デルタ法／ヒストリカル法VaRを計測します。
マスタ管理	取引相手情報管理	相手先コード、名称、住所、リスクウェイト、決済口座等を管理します。
	社内情報管理	社内部門、担当者、取引管理ブックの各コード設定とコード間の関連付けを管理します。
	休日情報管理	ロンドン、東京、ニューヨーク、ブリュッセル、トロント、その他都市の休日情報を管理します。
	評価用レート管理	市況レートの取り込み設定とヒストリカルレートを管理します。