


## 1. หน้า Upload File



**ออมสิน**  
สำนักงานส่งเสริมการค้าในต่างประเทศ

**ระบบรายงานฐานข้อมูลเพื่อบริหารความเสี่ยง**

Report

WEBADJUST

CPMWEBADJUST

AMBITREPORTINGSUITWEB

RDWeb

IRRBB

SETTING

Upload File

ตั้งค่า Parameter

ผลรายงาน

**Upload File**

ประจำเดือน

เมษายน

ปี

2562

Upload รายงานที่ออกจากระบบ ALM

ALM 1

ALM\_Report 7-1

Browse File

ALM 2

ALM\_Report 7-2

Browse File

Upload รายงานที่มีการปรับยอดแล้ว (Adjusted)

ALM 1\_ Adjusted \*

ALM 1 Adjusted by user

Browse File

ALM 2\_ Adjusted \*

ALM 2 Adjusted by user

Browse File

Upload

Cancel

**สถานะการ Upload**

ประจำเดือน

เมษายน

ปี

2562


Search

Cancel

ลำดับ	วันที่ Upload	รายงานประจำเดือน	ผู้ดำเนินการ	สถานะ
1	01/10/2561	กันยายน	วชิรา	สำเร็จ
2	01/11/2561	พฤศจิกายน	วชิรา	สำเร็จ
3	01/12/2561	ธันวาคม	วชิรา	ไม่สำเร็จ
4	05/12/2562	มกราคม	วชิรา	ยอดสินทรัพย์ไม่เท่ากัน
5	01/12/2562	กุมภาพันธ์	วชิรา	สำเร็จ

1 2 3 4 5

## 2. หน้า Set Parameter



**ธนาคาร  
ออมสิน**  
จัดตั้งระบบรายงานข้อมูลเพื่อบริหารความเสี่ยง

**ระบบรายงานฐานข้อมูลเพื่อบริหารความเสี่ยง**

Report WEBADJUST CPMWEBADJUST AMBITREPORTINGSUITWEB RDWeb IRRBB **SETTING**

Upload File ตั้งค่า Parameter ผลรายงาน

Main Parameter

สกุลเงิน

ล้านบาท

▼

ค่า CFO

☒ รายงาน CFO

จำนวน

XXXX

ล้านบาท

☐ แหล่งที่มาอื่น

XXXX

จำนวน

XXXX

ล้านบาท

Repricing

สัญญาณเตือนระดับความเสี่ยง ร้อยละ

เพดานความเสี่ยง ร้อยละ

การคำนวณผลกระทบช่วงเวลา

เดือน

Repricing

[Stress Setup parameter](#)

[Stress ALM 1](#)

[Stress ALM 2](#)

กราฟ NII

☐ 3 เดือน

☒ 5 เดือน

☐ 6 เดือน

☐ ไตรมาส

Other

หัวรายงาน

ฝ่ายบริหารความเสี่ยง ส่วนบริหารความเสี่ยงด้านตลาดและสภาพคล่อง

Save

Cancel

### 3. หน้า Stress Setup Parameter

[illegible]


4. หน้า Stress ALM 1

สถานการณ์ที่ 1																							
1		1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11	12	13	14	15	16	17	18	19	20		
ทพจ 250 hrs (FSAP)		line	Case	Effect (hrs)	เมื่อทพจรวม 0-1 เดือน >1-3 เดือน>3-6 เดือน>6-9 เดือน>9-12 เดือน > 1 - 2 ปี> 2 - 3 ปี > 3 - 4 ปี > 4 - 5 ปี> 5 - 7 ปี> 7 - 10 ปี> 10 - 15 ปี> 15 - 20 ปี > 20 ปีขึ้นไป															รวมรายการที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย		Non-rfHe sensitive	รวม
	1	2	5	(0.0250)	(33,750.00)	(4,250.00)	(5,250.00)	(9,000.00)	(7,500.00)	(1,250.00)	(1,750.00)	(1,750.00)	(750.00)	(3,000.00)	(500.00)	(250.00)	(250.00)	-	-	(62,500.00)	(3,250.00)	(128,250.00)	
	2	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
	3	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
	4	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
	5	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
10	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
50	2	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
รวมกรณีที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย (Total USA)				(33,750.00)	(4,250.00)	(5,250.00)	(9,000.00)	(7,500.00)	(1,250.00)	(1,750.00)	(1,750.00)	(750.00)	(3,000.00)	(500.00)	(250.00)	(250.00)	-	-	(62,500.00)	(3,250.00)	(128,250.00)		
1	4	5	(0.0250)	(13,000.00)	(4,000.00)	(5,750.00)	(4,750.00)	(5,500.00)	(3,000.00)	(6,250.00)	(9,250.00)	(3,000.00)	(1,500.00)	(500.00)	(250.00)	(250.00)	-	-	(57,000.00)	(8,750.00)	(122,750.00)		
2	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
3	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
4	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
5	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
10	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
50	4	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
รวมกรณีที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย (Total USA)				(13,000.00)	(4,000.00)	(5,750.00)	(4,750.00)	(5,500.00)	(3,000.00)	(6,250.00)	(9,250.00)	(3,000.00)	(1,500.00)	(500.00)	(250.00)	(250.00)	-	-	(57,000.00)	(8,750.00)	(122,750.00)		
1	7	5	(0.0250)	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
2	7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
3	7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
4	7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
5	7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
10	7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
50	7	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-		
รวมกรณีที่อ่อนไหวต่ออัตราดอกเบี้ย (Total USA)				-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	
รวมกรณี (Financial Gap)				20,750.00	250.00	500.00	4,250.00	4,750.00	1,750.00	4,500.00	7,500.00	2,250.00	1,500.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,500.00	5,500.00	(5,500.00)	
อัตราส่วน : ระยะเวลาที่รวมรวม พิจารณากรณีที่ไม่มีผลกระทบ				W	Weight	1.00	0.96	0.83	0.63	0.38	0.13	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00		
Proxy of Modified Duration				D	Duration Weight	0.00	-0.04	-0.16	-0.36	-0.71	-0.71	-1.38	-2.25	-3.07	-3.85	-5.08	-6.63	-8.92	-11.21	-13.01	0.00		
Nil						20,750.00	239.50	416.50	2,456.25	1,781.25	218.75	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	(21,229.25)		
EVE						0.00	10.00	80.00	1,530.00	3,372.50	1,242.50	6,210.00	16,875.00	6,907.50	5,775.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	(27,372.50)	
<div>SaveCancel</div>																							

## 5. หน้า Stress ALM

สถานการณ์ที่ 1					สถานการณ์ที่ 2					สถานการณ์ที่ 3				
1	1	2	20		2	1	2	20		3	1	2	20	
1. ผลกระทบประมาณ 0.25%	line	Case	Effect (bps)	รวม	2 ผลกระทบประมาณ 0.50%	line	Case	Effect (bps)	รวม	3. ผลกระทบประมาณ 1%	line	Case	Effect (bps)	รวม
1	1	-	-	-	1	1	-	-	-	1	1	-	-	-
2	2	-	-	-	2	2	-	-	-	2	2	-	-	-
3	3	-	-	-	3	3	-	-	-	3	3	-	-	-
4	4	-	-	-	4	4	-	-	-	4	4	-	-	-
5	5	-	-	-	5	5	-	-	-	5	5	-	-	-
6	6	-	-	-	6	6	-	-	-	6	6	-	-	-
7	7	-	-	-	7	7	-	-	-	7	7	-	-	-
8	8	-	-	-	8	8	-	-	-	8	8	-	-	-
9	9	-	-	-	9	9	-	-	-	9	9	-	-	-
10	10	-	-	-	10	10	-	-	-	10	10	-	-	-
11	11	-	-	-	11	11	-	-	-	11	11	-	-	-
12	12	-	-	-	12	12	-	-	-	12	12	-	-	-
13	13	9	(0.0025)	(750.00)	13	13	10	(0.0050)	(1,500.00)	13	13	11	(0.0100)	(3,000.00)
14	14	-	-	-	14	14	-	-	-	14	14	-	-	-
15	15	9	(0.0025)	(1,650.00)	15	15	10	(0.0050)	(3,300.00)	15	15	11	(0.0100)	(6,600.00)
16	16	9	(0.0025)	(1,350.00)	16	16	10	(0.0050)	(2,700.00)	16	16	11	(0.0100)	(5,400.00)
17	17	9	(0.0025)	(3,150.00)	17	17	10	(0.0050)	(6,300.00)	17	17	11	(0.0100)	(12,600.00)
18	18	9	(0.0025)	(3,200.00)	18	18	10	(0.0050)	(6,400.00)	18	18	11	(0.0100)	(12,800.00)
19	19	-	-	-	19	19	-	-	-	19	19	-	-	-
20	20	-	-	-	20	20	-	-	-	20	20	-	-	-
21	21	-	-	-	21	21	-	-	-	21	21	-	-	-
22	22	-	-	-	22	22	-	-	-	22	22	-	-	-
23	23	-	-	-	23	23	-	-	-	23	23	-	-	-
24	24	-	-	-	24	24	-	-	-	24	24	-	-	-
25	25	-	-	-	25	25	-	-	-	25	25	-	-	-
26	25	-	-	-	26	25	-	-	-	26	25	-	-	-
27	25	-	-	-	27	25	-	-	-	27	25	-	-	-
28	25	-	-	-	28	25	-	-	-	28	25	-	-	-
29	25	-	-	-	29	25	-	-	-	29	25	-	-	-
30	25	-	-	-	30	25	-	-	-	30	25	-	-	-
50	25	-	-	-	50	25	-	-	-	50	25	-	-	-
รวมสินทรัพย์ที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Total RSAs)				(10,100.00)	รวมสินทรัพย์ที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Total RSAs)				(20,200.00)	รวมสินทรัพย์ที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Total RSAs)				(40,400.00)
1	40	-	-	-	1	40	-	-	-	1	40	-	-	-
2	41	9	(0.0025)	-	2	41	10	(0.0050)	-	2	41	11	(0.0100)	-
3	42	9	(0.0025)	(2,300.00)	3	42	10	(0.0050)	(4,600.00)	3	42	11	(0.0100)	(9,200.00)
4	43	9	(0.0025)	(1,400.00)	4	43	10	(0.0050)	(2,800.00)	4	43	11	(0.0100)	(5,600.00)
5	44	9	(0.0025)	(1,650.00)	5	44	10	(0.0050)	(3,300.00)	5	44	11	(0.0100)	(6,600.00)
6	45	9	(0.0025)	(4,800.00)	6	45	10	(0.0050)	(9,600.00)	6	45	11	(0.0100)	(19,200.00)
7	46	9	(0.0025)	(500.00)	7	46	10	(0.0050)	(1,000.00)	7	46	11	(0.0100)	(2,000.00)
8	47	9	(0.0025)	-	8	47	10	(0.0050)	-	8	47	11	(0.0100)	-
9	48	9	(0.0025)	(300.00)	9	48	10	(0.0050)	(600.00)	9	48	11	(0.0100)	(1,200.00)
10	49	-	-	-	10	49	-	-	-	10	49	-	-	-
11	50	-	-	-	11	50	-	-	-	11	50	-	-	-
12	51	-	-	-	12	51	-	-	-	12	51	-	-	-
13	52	-	-	-	13	52	-	-	-	13	52	-	-	-
14	53	-	-	-	14	53	-	-	-	14	53	-	-	-
15	54	-	-	-	15	54	-	-	-	15	54	-	-	-
16	55	-	-	-	16	55	-	-	-	16	55	-	-	-
17	56	-	-	-	17	56	-	-	-	17	56	-	-	-
18	56	-	-	-	18	56	-	-	-	18	56	-	-	-
19	56	-	-	-	19	56	-	-	-	19	56	-	-	-
20	56	-	-	-	20	56	-	-	-	20	56	-	-	-
50	56	-	-	-	50	56	-	-	-	50	56	-	-	-
รวมหนี้สินที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Total RSLs)				(10,950.00)	รวมหนี้สินที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Total RSLs)				(21,900.00)	รวมหนี้สินที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Total RSLs)				(43,800.00)
1	69	9	(0.0025)	-	1	69	10	(0.0050)	-	1	69	11	(0.0100)	-
2	2	9	(0.0025)	(1,400.00)	2	2	10	(0.0050)	(2,800.00)	2	2	11	(0.0100)	(5,600.00)
3	7	9	(0.0025)	(450.00)	3	7	10	(0.0050)	(900.00)	3	7	11	(0.0100)	(1,800.00)
4	8	9	(0.0025)	(475.00)	4	8	10	(0.0050)	(950.00)	4	8	11	(0.0100)	(1,900.00)
5	10	9	(0.0025)	(125.00)	5	10	10	(0.0050)	(250.00)	5	10	11	(0.0100)	(500.00)
6	11	9	(0.0025)	-	6	11	10	(0.0050)	-	6	11	11	(0.0100)	-
7	11	-	-	-	7	11	-	-	-	7	11	-	-	-
8	11	-	-	-	8	11	-	-	-	8	11	-	-	-
9	11	-	-	-	9	11	-	-	-	9	11	-	-	-
10	11	-	-	-	10	11	-	-	-	10	11	-	-	-
50	11	-	-	-	50	11	-	-	-	50	11	-	-	-
ฐานสุทธิของจำนวนเงินตามสัญญาของการขายตราดอลล่าร์ที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Periodic Gap)				(2,450.00)	ฐานสุทธิของจำนวนเงินตามสัญญาของการขายตราดอลล่าร์ที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Periodic Gap)				(4,900.00)	ฐานสุทธิของจำนวนเงินตามสัญญาของการขายตราดอลล่าร์ที่ถือครองในหน่วยตราดอลล่าร์ (Periodic Gap)				(9,800.00)
ส่วนต่อ 1 ปีของ				(1,600.00)	ส่วนต่อ 1 ปีของ				(3,200.00)	ส่วนต่อ 1 ปีของ				(6,400.00)
Proxy of Modified					Proxy of Modified					Proxy of Modified				
Nil				(2,192.70)	Nil				(4,385.40)	Nil				(8,770.80)
EVE				(2,370.25)	EVE				(4,740.50)	EVE				(9,481.00)

## 6. Report Result



กรมการ  
**ออมสิน**  
สำนักงานอัยการสูงสุด

ระบบรายงานฐานข้อมูลเพื่อบริหารความเสี่ยง

Report   WEBADJUST   CPMWEBADJUST   AMBITREPORTINGSUITWEB   RDWeb   IRRBB   SETTING

Upload File   **ตั้งค่า Parameter**   ผลรายงาน

[รายงานเปรียบเทียบ](#)  
[รายงานวิเคราะห์](#)

Export File

รายงานเปรียบเทียบ (ALM 1&2)

กุมภาพันธ์

▼

Export File

Cancel