

市場風險

「表 6- A2-a」利率風險-一般市場風險之資本計提計算表 (到期法)

「表 6- A2-b」利率風險-一般市場風險之資本計提計算表 (存續期間法)

電子檔格式說明

1. 電子檔名格式:組成內容為 fs6a2a/fs6a2b(報表名稱)+資料日期+銀行代號

例如: (1)採用「表 6-A2-a」，銀行代號為 001，資料日期為 103 年 3 月底(3 月底以 03 標示，以此類推 6、9、12 月底則分別為 06、09、12)，檔案名稱請以「**fs6a2a10303001**」表示。

(2)採用「表 6-A2-b」，銀行代號為 001，資料日期為 103 年 3 月底，檔案名稱請以「**fs6a2b10303001**」表示。

2. EXCEL 試算表內容:請依隨附電子檔表格，將相關部位資料按幣別分填不同工作表。

(1)幣別代號請參閱試算表第 1 張工作表--「對照表」。

(2)試算表內建 33 種不同幣別部位之工作表，請將相關資料直接填寫於其對應之工作表(如新台幣部位填寫於「NTD」工作表、美金部位填寫於「USD」工作表...)。無前揭幣別部位者，則該工作表不必填寫。

(3)如有未屬前揭 33 種幣別者，請置於試算表之「其他 1」、「其他 2」...等工作表。

(4)請務必填寫填表人聯絡電話及電子信箱資料，以利後續聯繫事宜。(註：至少第二張工作表--「NTD」之表頭部分需有相關資料)

3.若有任何填報疑問，請電洽本處金融穩定評估科黃副科長淑君(02-2357-1464)、王朝永(02-2357-1463)。