

ค่าความเสี่ยงของสินทรัพย์ดิจิทัล

การคำนวณค่าความเสี่ยง

1. คำนวณ historical VaR โดยใช้ข้อมูลย้อนหลัง 1 ปี
2. จัดกลุ่มค่าความเสี่ยง 5 กลุ่ม คือ 20% 30% 50% 75% และ 100% โดยในแต่ละกลุ่มจะต้องมีค่า VaR ที่ปรับด้วย scaling factor ทั้งนี้ไม่เกินค่าความเสี่ยงดังกล่าว (กรณีไม่มีการซื้อขายเกิน 3 วัน ให้ปรับค่าความเสี่ยงเป็น 100%)

การทบทวนค่าความเสี่ยง

1. คำนวณ VaR ใหม่ทุก 3 เดือน หากมีสินทรัพย์ดิจิทัลใด ที่มีค่า VaR ที่ปรับด้วย scaling factor สูงกว่า 75% ให้ปรับค่าความเสี่ยงเป็น 100%
2. จัดกลุ่มใหม่ตามค่า VaR ทุก 6 เดือน
3. ทบทวนเกณฑ์การคัดเลือกสินทรัพย์ดิจิทัลและการคำนวณค่าความเสี่ยง ทุก 1 ปี

ตัวอย่างค่าความเสี่ยงตามกลุ่ม

กลุ่มค่าความเสี่ยง	สินทรัพย์ดิจิทัล
20%	bitcoin, cryptonex, dai, litecoin, maker, stellar, tetherzcash
30%	0x, aelf, aeternity, ardor, ark, augur, bancor, basic-attention-token, binance-coin, bitcoin-cash, bitcoin-gold, bitshares, bytecoin-bcn, bytom, cardano, chainlink, civic, crypto-com, dash, decentraland, decred, dentacoin, digibyte, digixdao, dogecoin, dragonchain, electroneum, enigma, enjin-coin, eos, ethereum, ethereum-classic, funfair, gas, genesis-vision, golem-network-tokens, gxchain, hypercash, icon, iota, kin, komodo, kucoin-shares, kyber-network, lisk, loopring, maidsafecoin, monacoin, monero, nano, nebulas-token, nem, neo, nuls, nxt, omisego, pivx, populous, power-ledger, qash, qtum, rchain, reddcoin, revain, ripple, salt, siacoin, status, steem, storj, stratis, syscoin, tenx, tron, verge, veritaseum, waltonchain, waves, zcoin, zencash
50%	tezos, mobilego, metaverse, substratum, cybermiles, factom, dent, wax, aion
75%	bitcoin-diamond