Summary of changes on “Risk Management Classification Document”

Update on Risk Management Classification Document version 1.2

Remark: All changes from version 1.1 to version 1.2 are in red font.

| **Version Number** | **Page No** | **Classification Name** | **Classification Value** | **Summary of Changes** |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.2 | 4 | Condition | - | เพิ่ม Classification ใหม่ |
| 9 | Market Risk Factor Type | - | เพิ่มคอลัมน์ V\_VAR และ V\_GRK |
| 9 | Market Risk Factor Type | Aggregate | Description  เปลี่ยนข้อความ  จาก “ความเสี่ยงรวมหรือความเสี่ยงที่ไม่สามารถแยกประเภทความเสี่ยงได้ ซึ่งใช้สำหรับชุดข้อมูล VaR”  เป็น “ความเสี่ยงรวมหรือความเสี่ยงที่ไม่สามารถแยกประเภทความเสี่ยงได้” |
| 9 | Market Risk Factor Type | FX | Description  เปลี่ยนข้อความ  จาก “ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน ซึ่งใช้สำหรับชุดข้อมูล VaR และ Greek”  เป็น “ความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน” |
| 9 | Market Risk Factor Type | IR | Description  เปลี่ยนข้อความ  จาก “ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย ซึ่งใช้สำหรับชุดข้อมูล VaR และ Greek”  เป็น “ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย” |
| 9 | Market Risk Factor Type | Commodity | Description  เปลี่ยนข้อความ  จาก “ความเสี่ยงด้านราคาสินค้าโภคภัณฑ์ ซึ่งใช้สำหรับชุดข้อมูล VaR และ Greek”  เป็น “ความเสี่ยงด้านราคาสินค้าโภคภัณฑ์” |
| 9 | Market Risk Factor Type | Equity | Description  เปลี่ยนข้อความ  จาก “ความเสี่ยงด้านราคาตราสารทุน ซึ่งใช้สำหรับชุดข้อมูล VaR และ Greek”  เป็น “ความเสี่ยงด้านราคาตราสารทุน” |
| 9 | Market Risk Factor Type | Others | Description  เปลี่ยนข้อความ  จาก “ความเสี่ยงประเภทอื่น ที่นอกเหนือจากความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย ความเสี่ยงด้านสินค้าโภคภัณฑ์ และความเสี่ยงด้านราคาตราสารทุน ซึ่งใช้สำหรับชุดข้อมูล VaR และ Greek”  เป็น “ความเสี่ยงประเภทอื่น ที่นอกเหนือจากความเสี่ยงด้านอัตราแลกเปลี่ยน ความเสี่ยงด้านอัตราดอกเบี้ย ความเสี่ยงด้านสินค้าโภคภัณฑ์ และความเสี่ยงด้านราคาตราสารทุน” |
| 9 | Market Risk Factor Type | Unspecified | Description  เปลี่ยนข้อความ  จาก“ความเสี่ยงที่ไม่สามารถแยกประเภทความเสี่ยงได้ตาม Market Risk Factor Type ซึ่งใช้สำหรับชุดข้อมูล Greek”  เป็น “ความเสี่ยงที่ไม่สามารถแยกประเภทความเสี่ยงได้ตาม Market Risk Factor Type” |
| 9 | Market Risk Factor Type | Total | Description  เปลี่ยนข้อความ  จาก “ความเสี่ยงรวมของค่า Greek ซึ่งใช้สำหรับชุดข้อมูล Greek”  เป็น “ความเสี่ยงรวมของค่า Greek” |
| 11 | Comparison operator | - | เพิ่ม Classification ใหม่ |