(翻譯本)

本局檔號： B9/129C
B1/15C

致： 所有認可機構
行政總裁

敬啟者：

<u>《監管政策手冊》單元 CR-G-14 「非中央結算場外衍生工具交易－－保證金及其他風險緩解標準」</u>

謹通知貴機構，經諮詢銀行界，金融管理專員根據《銀行業條例》第 7(3)條於今日在憲報刊登公告，發出《監管政策手冊》以上單元作為法定指引。該單元最後定稿曾於 2016 年 12 月 30 日預早向貴機構傳閱。[1]

該新單元載明金融管理專員預期認可機構就非中央結算場外衍生工具交易的保證金及其他風險緩解標準應採取的最低標準。

正如本局於 2016 年 12 月發出的通告所述，(i)第 1 階段機構[2] 的開倉保證金規定；及(ii)所有受涵蓋實體[3] 的變動保證金規定，將於 2017 年 3 月 1 日起分階段實施，並設為期 6 個月過渡期。[4]

認可機構可於金管局公眾網站(http://www.hkma.gov.hk)及專用網站(http://www.stet.iclnet.hk)「監管政策手冊」項下查閱該單元。

若對該單元有任何疑問，歡迎聯絡 Johannes Ehrentraud (jehrentraud@hkma.gov.hk)。

---

[1] 相對 2016 年 12 月 30 日傳閱的《監管政策手冊》單元最後定稿，刊憲的版本略有編輯修訂。

[2] 第 1 階段機構指其非中央結算衍生工具平均總計名義數額(依照《監管政策手冊》單元 CR-G-14 第 2.4.9 段計算)超過 24 萬億港元的認可機構。

[3] 依照《監管政策手冊》單元 CR-G-14 第 1.1.1 段定義。

[4] 請參閱本局於 2016 年 12 月 30 日通告有關過渡安排詳情。

助理總裁(銀行政策)
簡嘉蘭

2017 年 1 月 27 日

副本送：　香港銀行公會主席
存款公司公會主席
財經事務及庫務局 (收件人：張誼女士)