

乙部 諮詢問題

請在適當的方格上作出回應。如問卷預設的位置不敷應用，請另頁填寫。

香港交易所的建議 1：修改香港交易所的壓力測試假設

問題

1. 閣下／貴公司是否支持有關壓力測試中所用的價格變動假設的修訂建議？

- ☒ 同意
☐ 不同意

請說明原因，並提供任何其他相關建議或意見：

建議的價格變動假設為過往最高價格變動來制定，
是一個合理的數值。

2. 閣下／貴公司是否支持壓力測試中所用的對手失責假設的修訂建議？

- ☒ 同意
☐ 不同意

請說明原因，並提供任何其他相關建議或意見：

同意刪降 30% 對手失責的假設，因為該假設已
過時，另修訂建議可提升風險管理。

香港交易所的建議 2： 推出香港結算按金制度及浮動保證基金

問題

3. 閣下／貴公司是否同意香港結算推出按金制度的建議？

☒ 同意

☐ 不同意

請說明原因，並提供任何其他相關建議或意見：

同意，按金制度建議可提升資本充足水平及加強風險管理。

4. 閣下／貴公司是否同意香港結算設立浮動保證基金模式的建議？

☒ 同意

☐ 不同意

請說明原因，並提供任何其他相關建議或意見：

浮動保證基金所需金額由結算參與者按其各自分擔的市場風險比例支付，建議屬公平及合理。