

香港期貨結算有限公司
(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)
HKFE CLEARING CORPORATION LIMITED
(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項： 提示 - 修訂設定儲備基金金額的壓力測試假設
查詢： 熱線：2211-6901 / 電郵：CRM_Regulatory@hkex.com.hk

本通告參照於 2023 年 2 月 10 日發出的通告(編號：[CD/CDCRM/039/2023](#))。期貨結算所將自 2023 年 4 月 3 日起修訂違約假設，由現時最大及第五大結算參與者改為最大的兩名結算參與者及其聯號，作設定儲備基金金額。結算參與者應確保在實施前預備足夠資金作其儲備基金供款，結算參與者可提交至 CRM_Regulatory@hkex.com.hk 要求模擬結果，並註明有關事項及結算參與者公司名稱。

修訂違約假設後，若儲備基金金額達到限額(現時為七十三億港元)，而個別結算參與者及其聯號的潛在淨虧損超過儲備基金限額的 50%，期貨結算所將向結算參與者及其聯號¹收取儲備基金額外按金²。

如對上述事項有任何疑問，請聯絡熱線 2211 6901 或 CRM_Regulatory@hkex.com.hk。

香港期貨結算有限公司
授權簽署人

勞健滿 謹啟

¹ 結算參與者及其聯號中每位結算參與者之儲備基金額外按金將根據其所佔的潛在淨虧損比例計算

² 期貨結算所程序 2.2.8