

香港中央結算有限公司

(香港交易及結算所有限公司全資附屬公司)

HONG KONG SECURITIES CLEARING COMPANY LIMITED

(A wholly-owned subsidiary of Hong Kong Exchanges and Clearing Limited)

通告 CIRCULAR

事項: VaR 平台正式推出後的違約基金限額及非成份股類別 (N 類) 按金率

查詢: 電郵: NG_PostTrade@hkex.com.hk / VaR 平台熱線電話: 2211-6828

請注意以下風險管理安排將於 2022 年 6 月 13 日 (星期一) 正式推出 VaR 平台後同日生
效:

1. 香港中央結算有限公司的違約基金¹限額將由現時的 66 億港元修訂為 73 億港元; 及
2. 新風險模型 (即風險價值模型) 中的非成份股類別 (N 類) 劃一按金率將設定為 12%。
結算參與者應注意其按金率將以 N 類劃一按金率及其個別按金乘數來釐定。結算參與者可從報表檢索平台²檢索「每日參與者按金乘數報告」(DWH0081C) 以獲取其個別按金乘數。

違約基金限額及非成份股類別 (N 類) 按金率亦將於香港交易所網站公佈。

結算風險管理主管

勞健滿 謹啟

This circular has been issued in the English language with a separate Chinese language translation. If there is any conflict in the circulars between the meaning of Chinese words or terms in the Chinese language version and English words in the English language version, the meaning of the English words shall prevail. 本通告已以英文及另以中文譯本刊發。如本通告中文本的字義或詞義與英文本有所出入，概以英文本為準。

¹ 違約基金等同於中央結算系統一般規則中所使用的保證基金一詞。

² 連結到報表檢索平台註冊和維護表格([Client Connect eService: TechS 8](#))。