

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 Online 系統提升

查詢: CCASS 熱線電話: 2979 7111 / 電郵: clearingps@hkex.com.hk

香港中央結算有限公司欣然宣布提升 VaR Online，以增強結算參與者就其假設投資組合進行模擬按金及壓力測試之靈活性。

結算參與者現時可導入“CSV”格式檔案至 VaR Online 就其假設投資組合進行模擬按金及壓力測試，導入上限數目為 500 條交易 / 持倉。由 2022 年 12 月 12 日起，以“CSV”格式導入之假設交易 / 持倉上限數目將提升至 10,000 條以對有需要模擬更複雜投資組合的結算參與者提供支援。

詳情請於生效日起於 Client Connect 參閱更新後的 VaR Online 用戶指南。結算參與者也可觀看 [VaR Online 按金模擬器示範](#) 以了解使用模擬器計算按金及壓力測試的程序。

如有任何查詢，請致電 CCASS 熱線 2979 7111 或電郵至 clearingps@hkex.com.hk 查詢。

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。