

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: 新一代交易後平台 - 風險管理 (NGRM) 簡報會及培訓會

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

繼2019年10月23日發出的通告(編號: [CD/CDCRM/179/2019](#)), 為協助香港中央結算有限公司(「香港結算」)結算參與者準備在2020下半年度推出的 NGRM, 香港結算誠邀結算參與者於2020年1月參加NGRM準備簡報會及培訓會, 詳情如下:

1. NGRM簡報會 - 涵蓋關鍵項目的最新資訊, 包括NGRM準備事宜, 按金模擬計算器及技術指引
2. 風險系數檔案 (RPF) 培訓會 - 講解如何運用風險系數檔案及《初始按金計算指引》

所有結算參與者都應委派相關人員(建議一位項目/風險管理的人員及一位技術或系統開發人員)出席NGRM簡報會。對於因應新風險模型準備為其公司和/或客戶複製保證金計算的結算參與者, 建議同時參加RPF培訓會。在出席RPF培訓會前, 結算參與者應先細閱《[初始按金計算指引](#)》以了解整體保證金計算框架。

簡報會和培訓會詳情如下：

日期	時間	地點	語言
2020年1月20日 (星期一)	登記入場: 下午4時30分至下午5時正 NGRM 簡報會: 下午5時正至下午5時20分 RPF 培訓會: 下午5時20分至下午6時30分	中環交易廣場 1座及2座1樓 交易所金融大堂 第1區	廣東話
2020年1月21日 (星期二)			廣東話
2020年1月22日 (星期三)			英語

註: 對於僅報名出席第二節 (RPF 研討會) 的人員, 登記入場將從 17:00 開始。

結算參與者應於2020年1月15日或之前透過 [Client Connect](#)¹ 「活動」登記於參加簡報會及培訓會。座位有限, 將按照先到先得原則分配。

註: 尚未成為 Client Connect 用戶的結算參與者請儘快填妥及遞交 [Client Connect 管理人士權限申請/維護表格](#), 香港交易所將分批設立管理人士帳戶, 獲委任的管理人士將會在其帳戶成功建立後收到電郵通知。

NGRM 暫定於 2020 年下半年推出。因此, 結算參與者應開始計劃並做好相關準備。請參閱附錄以了解暫定的時間表及活動摘要。

為確保有效通訊, 香港結算將會定期提供有關 NGRM 的最新資訊以及即將舉行的活動詳情予結算參與者指定的項目統籌員。若還未提供項目統籌員 (建議提名兩位, 即主要和次要聯繫人), 請即填妥 [網上註冊表格](#)。

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。

附錄

暫定時間表	活動
2020年1月	a. 登記及參加NGRM簡報會和RPF培訓會 b. 細閱及了解新風險模型 <ul style="list-style-type: none"> - 初始按金計算指引 (只提供英文版) - 壓力測試計算指引 (只提供英文版) c. 細閱及準備技術設置 <ul style="list-style-type: none"> - 香港結算報表檢索平台技術指引 (只提供英文版) - 電腦及網絡要求指引 (只提供英文版) d. 開啟開發自家按金模擬計算器和風險管理工具 (如適用)
2020年2月	a. 登記及參加 <ul style="list-style-type: none"> - 熟練計劃簡報會 - 季度性項目簡介會 (2020年2月) b. 技術設置 <ul style="list-style-type: none"> - 香港結算報表檢索平台(RAP)和提交RAP登記表 (只提供英文版), 並於2020年4月完成登記 - NGRM網上連接 c. 細閱新及修改後的報告和資料檔案規格
2020年3月至8月	a. 細閱NGRM網上連接使用者指引 <u>熟練計劃</u> b. 細閱及了解 <ul style="list-style-type: none"> - 按金影響數據分析 - 按金對照資訊 c. 參加透過NGRM進行線上按金模擬計算實習環節 (須註冊)
2020年4月	a. 登記及參加NGRM功能簡報會 b. 提交NGRM網上連接登記表(將於2020年3月上載)
2020年5月	a. 登記及參加季度性項目簡介會 (2020年5月)

暫定時間表	活動
2020年6月/7月	<ul style="list-style-type: none"> a. 驗證RAP技術設置和連通性 b. 登記及參加項目推出部署簡報會 c. 細閱項目推出簡介文件
2020年8月	<ul style="list-style-type: none"> a. 登記及參加 <ul style="list-style-type: none"> - 季度性項目簡介會（2020年8月） - 市場演習簡介會
2020年9月/10月	<ul style="list-style-type: none"> a. 初始階段項目推出為結算參與者的試用期，以： <ul style="list-style-type: none"> - 通過RAP檢索及參考NGRM報告/數據文件 - 細閱並了解新的NGRM報告/數據文件 - 登入NGRM線上連接及進行實習 b. 登記及參加市場演習 c. 正式業務啟動