

(翻譯本)

本局檔號：B1/21C

致： 所有持牌銀行
行政總裁

敬啟者：

《監管政策手冊》

CG-7「基準報價機構操守準則」

謹通知貴機構金融管理專員在完成諮詢香港銀行公會(銀行公會)後，將根據《銀行業條例》第 7(3)條以法定指引形式發出《監管政策手冊》單元「基準報價機構操守準則」。本指引將於 2013 年 5 月 3 日以公告形式在憲報刊登。

因應國際有關基準定價活動的發展，銀行公會於 2012 年 7 月委託香港財資市場公會檢討港元結算利率(一般稱為香港銀行同業拆息)的定價機制。香港財資市場公會在 2012 年 11 月提出從五方面優化香港銀行同業拆息定價機制的建議。有關建議的其中一個要點，是制定操守準則讓報價銀行遵守，內容涵蓋利率報價的清晰指引及定價程序的穩健管控制度。於 2013 年 2 月，金管局接納兩個公會的建議，包括由業內制定操守準則的意見。然而，考慮到國際對金融市場基準的討論及香港銀行同業拆息的重要性，金管局決定應根據《銀行業條例》第 7(3)條以《監管政策手冊》單元的形式發出操守準則。

本《監管政策手冊》單元旨在列載適用於認可機構作為報價機構應設立的管控制度的監管要求。單元設計普遍適用於所有報價機構，雖然暫時我們只要求香港銀行同業拆息的報價銀行遵守。附件所載的操守準則詳

述對管控制度的要求，並載有就香港銀行同業拆息定價提供報價的指引。認可機構應注意，當離岸人民幣結算利率(又稱人民幣香港銀行同業拆息定價)於 2013 年 6 月正式推出後，本《監管政策手冊》單元亦適用於有關的定價機制。預計這項新指標亦會有操守準則，並主要會參照港元香港銀行同業拆息的操守準則，對提供報價指引作出適當修訂後制定。人民幣香港銀行同業拆息的操守準則會在適當諮詢業界後列入本《監管政策手冊》單元。

就基準定價提供報價的認可機構應積極採取措施，盡快符合本《監管政策手冊》單元所載指引，並在有關憲報公告的刊發日期起計 6 個月內全面遵守指引的要求。

認可機構可於金管局公眾網站(<http://www.hkma.gov.hk/>)或專用網站(<http://www.stet.iclnet.hk>)的《監管政策手冊》項下查閱本單元全文。

貴機構如對本單元有任何疑問，請聯絡負責貴機構一般監管事務的金管局職員。

助理總裁(銀行監理)

鄭發

2013 年 4 月 29 日

副本送交：香港銀行公會主席

財經事務及庫務局(收件人：廖俊傑先生)