

(翻譯本)

本局檔號： B1/15C
B9/75C
S4/2C
S4/3C

致： 所有本地註冊認可機構
行政總裁

敬啟者：

市場風險資本規定——本地實施時間表

關於巴塞爾銀行監管委員會(巴塞爾委員會)於 2016 年 1 月 14 日發出「*市場風險最低資本規定*」的新標準¹，本局曾於 2016 年 1 月 19 日向貴機構發出通告。

根據原定時間表，各國/地區監管機構須於 2019 年 1 月 1 日或之前實施新標準，而銀行須由 2019 年 12 月 31 日起開始根據經修訂的標準計算法及/或內部模式計算法作出監管申報。

然而，鑑於新標準涉及高度複雜性，過去數月出現若干實施方面的問題，當中涉及某些根本事項，以致可能需要修訂新標準，而非單純作出技術性澄清可以解決問題。因此，各國/地區在依照巴塞爾委員會時間表實施新標準上越加面臨挑戰。

有鑑於此，金管局已決定至少在 2020 年 1 月 1 日或以後才在香港實施新標準。

金管局計劃就新標準發出諮詢文件，包括一份關於標準計算法的諮詢文件(將於 2017 年稍後時間發出)，及一份關於內部模式計算法的諮詢文件(將於 2018 年春季發出)。金管局會適時通知業界有關本港實施時間表方面的最新進展。

如對本通告有任何疑問，請聯絡李海宏先生(2878 1540 或 hhwlee@hkma.gov.hk)。

¹ <http://www.bis.org/bcbs/publ/d352.pdf>

助理總裁(銀行政策)

何漢傑

2017 年 6 月 23 日

副本送： 香港銀行公會主席
存款公司公會主席
財經事務及庫務局 (收件人：張誼女士)