

(翻譯本)

本局檔號： B1/15C
B1/21C
S4/15C

致： 所有認可機構
行政總裁

敬啟者：

《監管政策手冊》——經修訂單元 CR-G-13「對手方信用風險管理」

謹通知貴機構，經諮詢兩個業內公會後，金融管理專員今日以建議文件形式發出《監管政策手冊》上述單元的修訂版。

該《監管政策手冊》單元修訂的主要目的，是納入巴塞爾銀行監管委員會¹及金融穩定理事會²發出的相關國際標準及指引。此外，該單元內部分指引已作更新，以確保與巴塞爾資本架構下對手方信用風險的資本處理方法一致。該單元涵蓋範圍亦擴展至由信用估值調整及中央結算引起的相關事項。

該單元可於金管局公用網站(<http://www.hkma.gov.hk/chi/key-functions/banking-stability/supervisory-policy-manual.shtml>)及專用網站(<http://www.stet.iclnet.hk>)查閱。

¹ [《有效的風險數據匯集及風險匯報的原則》](#) (2013 年 1 月)。

² [非中央結算證券融資交易扣減的監管框架](#) (2015 年 11 月) 及 [處理證券借出及回購協議中影子銀行風險的政策框架](#) (2013 年 8 月)。

認可機構應按照該單元所載指引評估其對手方信用風險管理制度，並制定行動計劃，在合理時限內(由該單元發出日期起計不多於一年)處理所發現的任何不足之處。若對實施時限有任何疑問，請聯絡金管局負責貴機構一般監管事務的人員。

助理總裁(銀行政策)
何漢傑

2018 年 7 月 3 日

連附件

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)