

2023 年第 150 號法律公告

《2023 年證券及期貨 (場外衍生工具交易——結算及備存紀錄責任和中央對手方的指定)(修訂)規則》

(由證券及期貨事務監察委員會根據《證券及期貨條例》(第 571 章)第 101N 及 101P 條在金融管理專員同意下及在諮詢財政司司長後訂立)

- 1. 生效日期
本規則自 2024 年 7 月 1 日起實施。
- 2. 修訂《證券及期貨 (場外衍生工具交易——結算及備存紀錄責任和中央對手方的指定)規則》
《證券及期貨 (場外衍生工具交易——結算及備存紀錄責任和中央對手方的指定)規則》(第 571 章，附屬法例 AN)現予修訂，修訂方式列於第 3 條。
- 3. 修訂附表 1 (為施行結算責任和備存紀錄責任的指明場外衍生工具交易)
 - (1) 附表 1，表 1——
廢除第 1、3 及 4 項。
 - (2) 附表 1，表 2——
廢除第 1、3 及 4 項。
 - (3) 附表 1，表 3——
廢除第 2 項

代以

“2. 歐元 歐元短期 7 日至 3 年 沒有 是”。

利率

(4) 附表 1，表 3，第 3 項——

廢除

“2 年”

代以

“50 年”。

(5) 附表 1，表 3，在第 3 項之後——

加入

“4. 日元 東京隔夜 7 日至 30 年 沒有 是

平均利率

5. 美元 擔保隔夜 7 日至 50 年 沒有 是

融資利率

6. 港元 港元隔夜 7 日至 10 年 沒有 是”。

平均指數

證券及期貨事務監察委員會
行政總裁
梁鳳儀

2023 年 10 月 18 日

註釋

本規則的目的是就施行結算責任和備存紀錄責任而對《證券及期貨 (場外衍生工具交易——結算及備存紀錄責任和中央對手方的指定) 規則》(第 571 章，附屬法例 AN) (**《主體規則》**) 作出以下的修訂——

- (a) 從《主體規則》附表 1 表 1 及 2 刪除以倫敦銀行同業拆息作為浮動息率指數的場外衍生工具交易，以使該等交易不再屬為施行《主體規則》第 4 及 5 條而被指明的場外衍生工具交易；及
- (b) 在《主體規則》附表 1 表 3 更新隔夜指數掉期的列表，即——
 - (i) 刪除以歐元隔夜銀行間拆借利率平均值作為浮動息率指數的隔夜指數掉期；
 - (ii) 加入以歐元短期利率、東京隔夜平均利率、擔保隔夜融資利率或港元隔夜平均指數作為浮動息率指數的隔夜指數掉期；及
 - (iii) 更新以英鎊隔夜銀行間拆借利率平均值作為浮動息率指數的隔夜指數掉期的投資期。

2. 第 1 條就本規則的生效日期訂定條文。

3. 第 3 條修訂《主體規則》附表 1 表 1、2 及 3。