

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： 復活節假期前即日追收按金安排
查詢： 熱線 2979-7111

聯交所運作的證券市場將於2018年3月30日至4月2日休市。由於一些主要市場在此期間仍然開市，為確保妥善管理上述期間的市場風險，根據中央結算系統運作程序規則第10.10A.5節，香港結算將於2018年3月29日收取即日按金。結算參與者請注意以下有關安排：

即日按金的計算及收取

1. 香港結算將於 2018 年 3 月 29 日約下午 2 時就所有待交收的持續淨額交收股份數額計算即日按金。除了計算上剔除到期及逾期交收的持續淨額交收股份數額和到期及逾期交收的持續淨額交收股份數額與無擔保的已分配數額的順差額繳款不可用作抵銷外，即日按金計算與日終按金計算相同。於上述日期下午 2 時的即日差額繳款計算中，待交收的持續淨額交收股份數額的順差額繳款將用以抵銷即日按金金額。
2. 香港結算在追收即日按金時，只會向結算參與者收取不足的按金，並不會退回多於按金金額之現金。
3. 香港結算將於 2018 年 3 月 29 日向結算參與者的指定銀行發出直接記除指示(DDI)收取即日按金的不足款額以作為中央結算系統款項交收程序的一部分，並透過「傍晚銀行同業大批交收程序」交收。

即日按金的通知

4. 於 2018 年 3 月 29 日即日按金程序完成後，以下的廣播訊息將於約下午 2 時 45 分在中央結算系統發放以通知結算參與者下載即日按金報告。

“Intra-day Margin process is completed. Please retrieve CRMMG01 Intra-day Margin Payable Report.”

5. 有關即日按金的計算詳情，結算參與者可下載並參閱「即日應付按金報告」(CRMMG01)及「非結算參與者預測按金報告」(CRMNP03) (如適用)。

敬請各結算參與者與貴指定銀行安排所需資金，以便履行於 2018 年 3 月 29 日的即日按金款項責任。

香港結算特別提醒結算參與者於假期前後的正常交收日，必須有適當的安排。如有主要員工因假期而缺席，請確保後備員工熟悉有關的營運與監控程序，使閣下能夠充分地監控風險及按時履行由香港結算所發出的款項責任。根據中央結算系統一般規則第 3701 條，結算參與者若不能於指定時限內履行由香港結算發出的款項責任將會構成失責事件。請參閱於 2018 年 1 月 26 日發出的通告 (編號：[CD/CDCRM/021/2018](#))，詳細了解有關結算參與者的款項責任以及延遲或不能履行款項責任的後果。

如對上述資料有任何疑問，請致電熱線 2979 7111 查詢。

現貨及衍生產品結算風險管理

副總裁

李麗儀 謹啟