

編號 RMD/CCRM/003/2012  
Ref. No.:  
日期 2012年6月25日  
Date: 25 June 2012

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**

---

致  
To: 中央結算系統參與者

事項  
Subject: 有關推行香港結算風險管理改革措施的中央結算系統(CCASS)及共同抵押品管理系統(CCMS)服務提升

查詢  
Enquiry: 熱線 2979 7111 或雷露露小姐 2211 6907

請參照於 2012 年 5 月 14 日發出的有關通告(編號: RMD/CCRM/002/2012)。香港結算將於 2012 年第 3 季實施風險管理改革措施(改革措施)，相關規則的修訂有待證券及期貨事務監察委員會(證監會)的批准。各項主要改革措施及有關細節已詳述於 2012 年 5 月 14 日發出之有關通告(編號: [RMD/CCRM/002/2012](#))。

實施改革措施需提升的 CCASS 及 CCMS 服務，包括修改和推行新增功能及報告如下：

1. 修改現時報告及功能  
以下 CCASS 及 CCMS 現時的報告及功能將作出修改：
  - a. 抵押品戶口結存查詢功能
  - b. 應繳差額繳款及抵押品報告(CFIPM01)及應繳即日差額繳款及抵押品報告(CRMIM01)
  - c. 非結算參與者差額繳款預測報告(CRMNP01/02)
  - d. 中央結算系統的保證基金供款報告(GFR608)
  - e. 抵押品戶口結存報告(CCMCA02)
  - f. 抵押品戶口報表(CCMDS01)
  - g. 參與者抵押品戶口變動報告(CCMMV01)
  - h. 記入／計算抵押數額結果報告(CCMPY01/02)
  - i. 款項記帳結存單(CSEMA08/CSEMS08)

香港交易及結算所有限公司  
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited

## 2. 新增 CCASS 及 CCMS 的報告及功能

以下報告及功能將新增於 CCASS 及 CCMS：

- a. 指定現金抵押品戶口轉移查詢功能
- b. 差額繳款及按金首選單一結算貨幣修訂功能
- c. 指定現金抵押品修訂功能
- d. 指定現金抵押品指示活動報告(CCMSC01)
- e. 即日應付按金報告(CRMMG01)
- f. 應付按金報告(CRMMG02)
- g. 非結算參與者預測按金報告(CRMNP03/04)
- h. 修訂首選單一結算貨幣活動報告(CCMP01)
- i. 非結算參與者預測保證基金供款報告(GFR616)

參與者可參閱**附件一**，檢視有關功能及報告提升的名單。相關的報告規格、報告描述及數據檔案樣本已載於下列之香港交易所網址：

<http://www.hkex.com.hk/eng/market/clr/secclr/ccass3/enhancement.htm>.

為使結算參與者瞭解即將推行的新措施，於正式實行改革措施前將為結算參與者提供按金及保證基金的模擬報告。我們將為結算參與者舉辦簡介會，以講解改革措施、有關報告、系統提升及解答結算參與者的查詢。有關模擬報告的安排及簡介會時間將於稍後公佈。如對上述資料有任何疑問，請致電熱線 2979 7111 或雷露露小姐 2211 6907 查詢。

風險管理科  
現貨結算風險管理總監  
陳達元 謹啟

**CCASS 及 CCMS 的報告及功能修改名單**

1. 現時報告及功能提升

功能及報告名稱和提升描述	
a.	抵押品戶口結存查詢功能 <ul style="list-style-type: none"> <li>查詢有關於待交收及確認狀況流動及凍結之指定現金抵押品(SCC)金額</li> </ul>
b.	應繳差額繳款及抵押品報告(CFIPM01) 及應繳即日差額繳款及抵押品報告(CRMIM01) <ul style="list-style-type: none"> <li>顯示以 CNS 股份數額交易貨幣計算的差額繳款及集中抵押金</li> </ul>
c.	非結算參與者差額繳款預測報告(CRMNP01/02) <ul style="list-style-type: none"> <li>提供全面結算參與者(GCP)旗下之非結算參與者(NCP)以 CNS 股份數額的交易貨幣計算之所預測待交收數額的差額繳款</li> </ul>
d.	中央結算系統的保證基金供款報告(GFR608) <ul style="list-style-type: none"> <li>改名為「保證基金供款報告」及就現行的保證基金加入浮動部份而須修改報告內容</li> </ul>
e.	抵押品戶口結存報告(CCMCA02) <ul style="list-style-type: none"> <li>顯示 SCC 資料</li> </ul>
f.	抵押品戶口報表(CCMDS01) <ul style="list-style-type: none"> <li>顯示 SCC 之結餘及交易變動</li> </ul>
g.	參與者抵押品戶口變動報告(CCMMV01) <ul style="list-style-type: none"> <li>顯示 SCC 於 CCMS 抵押品戶口之變動</li> </ul>
h.	記入／計算抵押數額結果報告(CCMPY01/02) <ul style="list-style-type: none"> <li>顯示於即日應付差額繳款及集中抵押金於扣減寬限水平之前和之後的差額金額</li> <li>顯示於收取差額繳款、集中抵押金及按金差額時，以原來交易貨幣兌換至首選單一結算貨幣之兌換結果</li> </ul>
i.	款項記帳結存單 (CSEMA08/CSEMS08) <ul style="list-style-type: none"> <li>以貨幣將戶口區分</li> <li>貨幣欄位將加於每組戶口之前</li> </ul>

2. 新增 CCASS 及 CCMS 的報告及功能

功能及報告名稱和描述	
a.	指定現金抵押品戶口轉移查詢功能 <ul style="list-style-type: none"> <li>讓結算參與者查詢過去 30 辦公日的 SCC 轉移</li> </ul>
b.	差額繳款及按金首選單一結算貨幣修訂功能 <ul style="list-style-type: none"> <li>提供選擇以首選單一結算貨幣支付差額繳款及按金的差額</li> <li>選擇的貨幣預設為港元</li> <li>若選擇「N/A」，差額繳款、按金及集中抵押金的差額將以 CNS 數額計價貨幣收取</li> </ul>
c.	指定現金抵押品修訂功能 <ul style="list-style-type: none"> <li>提供結算參與者輸入 SCC 金額及選擇繳付方式</li> </ul>
d.	指定現金抵押品指示活動報告(CCMSC01) <ul style="list-style-type: none"> <li>顯示結算參與者的存入指示輸入活動</li> </ul>
e.	即日應付按金報告(CRMMG01) <ul style="list-style-type: none"> <li>報告於計算即日按金當日約上午 11 時 45 分或約下午 2 時 45 分供結算參與者查閱有關按金要求</li> </ul>
f.	應付按金報告(CRMMG02) <ul style="list-style-type: none"> <li>報告於每個交易日約晚上 8 時 15 分供結算參與者查閱有關按金要求</li> </ul>
g.	非結算參與者預測按金報告(CRMNP03/04) <ul style="list-style-type: none"> <li>提供全面結算參與者(GCP)其下之非結算參與者(NCP)以 CNS 股份數額交易貨幣計算之預測待交收數額的按金</li> </ul>
h.	修訂首選單一結算貨幣活動報告(CCMPS01) <ul style="list-style-type: none"> <li>提供結算參與者於當日輸入的首選單一結算貨幣修訂活動</li> </ul>
i.	非結算參與者預測保證基金供款報告(GFR616) <ul style="list-style-type: none"> <li>提供全面結算參與者(GCP)其下之非結算參與者(NCP)的預測保證基金供款數額</li> </ul>