

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: 模擬報告及香港結算風險管理改革措施(改革措施)簡介會

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(編號:[RMD/CCRM/002/2012](#))及2012年6月25日(編號:[RMD/CCRM/003/2012](#))發出的有關通告。待證券及期貨事務監察委員會(證監會)對相關規則修訂完成審批及市場準備就緒後,香港結算將於本年稍後時間推行此改革措施。有關正式推行日期,我們將於確定後,盡快通知結算參與者。

模擬報告

1. 以下模擬報告將於正式推行改革措施前提供給結算參與者:

模擬報告名稱 (報告編號)	供應期
a. 應付按金報告(模擬) (CRMMG02)	由2012年7月30日日終至推行日期
b. 非結算參與者預測按金報告(模擬) (CRMNP04)	
c. 保證基金供款結單(模擬) (GFS608)	由2012年8月2日至推行日期期間之每月第二個辦公日
d. 非結算參與者預測保證基金供款報告(模擬) (GFS616)	

2. 結算參與者可於CCASS終端機的Report Download功能下載模擬報告。結算參與者亦可於Overnight Report Distribution功能選擇由指定的印表機直接列印應付按金報告(模擬) (CRMMG02)及非結算參與者預測按金報告(模擬) (CRMNP04)。

3. 香港結算於模擬期間不會向結算參與者收取按金及浮動供款。然而，模擬報告將提供結算參與者於改革措施下根據結算參與者的持倉及其他適用於模擬期的市場資料預測所需的按金及保證基金供款。某些服務提升項目，例如存入指定現金抵押品 (SCC) 及修訂首選單一結算貨幣用以繳付差額繳款、按金及集中抵押金，將於正式推行後才提供給結算參與者。因此，(i) 應付按金報告(模擬)內的E部份“Pending Position Covered by SCC”和G部份“Margin Shortfall”；及(ii) 保證基金供款結單(模擬)內有關“Amount due From/(To) Your Company”部份將不適用。結算參與者需注意模擬報告所提供的資料僅供參考。所有模擬報告將註有「模擬」以茲識別。相關的報告規格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>

簡介會

4. 為讓結算參與者對改革措施的主要項目和有關改革措施的CCASS 服務提升有進一步的了解，以及協助結算參與者為準備實施按金及浮動供款作出安排，現邀請結算參與者出席於2012年8月16日，17日及20日舉辦的其中一節簡介會，時間為下午5:00至6:30。簡介會內容包括：
- i) 以首選單一結算貨幣收取按金，差額繳款及集中抵押金與及收取浮動供款
 - ii) 新增 / 提升的 CCASS 及 CCMS 功能及報告
 - iii) 針對實施改革措施安排的準備

每名結算參與者可派兩名代表 (建議為負責有關結算及交收之營運代表及/或技術支援人員) 出席簡介會。如欲參與任何一節簡介會，請填妥於附件一的報名表格 (只有英文版)，並於2012年8月3日 (星期五) 前傳真至2579-0111。每節入座名額均以先到先得形式分配。

結算參與者可於以下香港交易所網址進一步了解改革措施的資料：
http://www.hkex.com.hk/chi/market/rm/rm_reform/rm_reform_c.htm

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

**Enrolment Form for Attending Briefing Sessions on
HKSCC Risk Management Reform Measures**

To: Cash Clearing Risk Management
8/F Infinitus Plaza
199 Des Voeux Road Central
Hong Kong
Fax: 2579 0111

Section I: Participant Information

Participant ID & Name: _____

Contact Person: _____

Telephone No.: _____ Fax No.: _____

Section II: Details of Briefing Sessions:

Subject: HKSCC Risk Management Reform Measures
Venue: The Auditorium, The Exchange Exhibition Hall, 1/F, One and Two Exchange Square, Central
Time: 5:00 p.m. to 5:15 p.m. (registration)
5:15 p.m. to 6:30 p.m. (briefing session)
Date: 16, 17 and 20 August 2012

The briefing sessions will primarily be conducted in Cantonese. English session will be arranged on a request basis. Each Participant may nominate a maximum of 2 persons to attend the subject briefing session(s).

Please tick (✓) one session only:

Name in English or Chinese (in Block Letters)	Position	Choice of Date (<i>please tick the appropriate box</i>)		
		16 August (Thu)	17 August (Fri)	20 August (Mon)
1.				
2.				
If seats are available				
3.				

Authorised Signature(s)
with Company Chop: _____
Date: _____

Notes:

- **Completed Enrolment Form should be returned to Cash Clearing Risk Management by fax (2579-0111) on or before 3 August 2012 (Friday).**
- **No confirmation will be given to participants for successful nominations. Only unsuccessful nominations will be contacted via phone. Participants are advised to keep the completed Enrolment Form for record.**