

期貨結算所規則及程序

第二章 結算及交收程序

2.2.7 額外結算所按金 – 集中按金

2.2.7.1 期貨結算所根據其釐定的每一歷史已實現之市場壓力情況下，及／或每一假設性未實現之市場壓力情況下，期貨結算所參與者就其擁有屬於相同，或期貨結算所不時指定及通知期貨結算所參與者屬於相關財務工具的未平倉期貨及期權合約，將被收取額外結算所按金：

- (a) 該期貨結算所參與者登記於其綜合客戶戶口、個別客戶戶口、客戶按金對銷戶口、暫存戶口、公司戶口及莊家戶口內，擁有未平倉期貨及期權合約持倉所產生的潛在虧損總和（減去結算所按金）（“集中潛在淨虧損”），超出所有期貨結算所參與者總集中潛在淨虧損的30%；及
- (b) 所有期貨結算所參與者擁有相同或相關財務工具的未平倉期貨及期權合約的總集中潛在淨虧損超過五百萬港元或期貨結算所不時指定及通知期貨結算所參與者的其他金額。

此外，主席亦可在其認為其他適當的情況下，就期貨結算所參與者於期貨結算所戶口內登記的所有期貨及期權合約，收取額外結算所按金。

2.8B 強制即日變價調整及按金

除期貨結算所另行規定外，於每個營業日T時段開市後，期貨結算所會就期貨結算所參與者於開市前，在設有T+1時段的市場及任何擁有與該市場相同或類似相關工具的任何其他市場所持有的全部未平倉合約，當中包括於前一個T+1時段交易的合約，追收強制即日變價調整及按金。期貨結算所參與者宜於T時段開市前一段由期貨結算所不時指定的時間內完成所有根據程序第1.4條及第1.5條對於T+1時段執行的交易之後交易調整。此後之任何後交易調整有可能不被納入計算強制即日變價調整及按金中。

附錄 A

費用

說明

金額¹

結算費(期貨)及行使費(期權)

股票指數產品

MSCI 澳洲淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 中國自由 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 中國自由淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場亞洲 (中國除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場亞洲 (韓國除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場亞洲淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場歐非中東淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場 (中國除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場 (韓國除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場拉丁美洲淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新興市場淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 香港淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 印度 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 印度淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 印尼 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 印尼淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 日本淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 馬來西亞 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 馬來西亞淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 紐西蘭淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 太平洋 (日本除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 太平洋淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 菲律賓 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 菲律賓淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新加坡自由淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 新加坡淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 台灣 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 台灣淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 泰國 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 泰國淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元
MSCI 越南 (美元) 指數期貨	每張1.00美元
MSCI 越南淨總收益 (美元) 指數期貨	每張0.60美元

附錄 B

T+1 時段截止時間

產品	時間
<u>股票指數產品</u>	
MSCI 澳洲淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 中國自由 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 中國自由淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場亞洲 (中國除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場亞洲 (韓國除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場亞洲淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場歐非中東淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場 (中國除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場 (韓國除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場拉丁美洲淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新興市場淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 香港淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 印度 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 印度淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 印尼 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 印尼淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 日本淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 馬來西亞 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 馬來西亞淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 紐西蘭淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 太平洋 (日本除外) 淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 太平洋淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 菲律賓 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 菲律賓淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新加坡自由淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 新加坡淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 台灣 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 台灣淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 泰國 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 泰國淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 越南 (美元) 指數期貨	凌晨三時正
MSCI 越南淨總收益 (美元) 指數期貨	凌晨三時正