

中央結算系統運作程序規則

第十六節

報表及報告

16.6 為參與者提供的報告及報表

16.6.1 為非投資者戶口持有人的參與者提供的報告及報表

報告編號	報告名稱	發出頻次	提供時間
GFR608	保證基金供款結單	每月/不定時	<u>上午八時後不久約中午十二時在保證基金檢討程序完成後</u>
GFR616	非結算參與者預測 保證基金供款報告	每月/不定時	<u>上午八時後不久約中午十二時在保證基金檢討程序完成後</u>

第十八節

保證基金

18.2 供款的計算

18.2.1 款額的決定

結算參與者所需繳納的基本供款額將參考其上月最近六十個工作天平均的「每日持續淨額交收數額」的市場佔有率而定，但不得低於最低現金基本供款額。各直接結算參與者的最低現金基本供款額為五萬港元，或就其在聯交所每持有一個聯交所交易權而繳納五萬港元(取較高者)，而各全面結算參與者的最低現金基本供款額則為十五萬港元，或就其持有的每一個聯交所交易權而繳納五萬港元，另再就每一名與其訂有結算協議的非結算參與者 繳納五萬港元(取較高者)。所有結算參與者的所需基本供款總額一般為不少於一億港元，唯結算公司保留不時釐定所需基本供款總額的權利。

結算公司亦會參照上述結算參與者的最近六十個工作天平均的「每日持續淨額交收數額」的市場佔有率計算各結算參與者的浮動供款的市場佔有率。市場的「計算的浮動供款」指結算公司在檢討保證基金總額規模後，減去所有結算參與者的所需基本供款總額及任何結算公司自行決定認為合適用以扣減所有參與者的所需「計算的浮動供款」後得出來的所需保證基金總額。各結算參與者相對於所有參與者所佔有的「計算的浮動供款」按貨幣計算便是該結算參與者的「計算的浮動供款」。

18.4 供款的檢討

18.4.2 不定時的檢討

當結算公司計算的每日保證基金的風險連續兩個工作天超過當時的保證基金及所有結算參與者的已使用浮動供款豁免額的總額之百分之八九十或在任何結算公司認為適當的情況下，結算公司可不時全權酌情決定，檢討保證基金總額及每一結算參與者的基本及浮動供款額。該等由結算公司進行的檢討可在任何時間進行，就算有關供款額的每月檢討在其近期已作出或快將完成。結算公司最低限度會每月檢討保證基金總額一次及結算公司並可根據每月檢討或不定時檢討的結果，要求結算參與者繳付額外基本及/或浮動供款。

18.6 保證基金的補充

18.6.1 由結算參與者補充供款

凡相關結算參與者的全部或任何部份基本供款及/或浮動供款按規則第 2507 及 2507A 條被動用，結算公司將要求相關結算參與者補充由於動用其基本供款及浮動供款而引致的短缺。結算公司會通知相關結算參與者並要求補充在「運用通知」內的供款短缺。而相關結算參與者須在「運用通知」日後不遲於三一個工作天或結算公司可指定的其他期間內補充其供款短缺。