

乙部 咨询问题

请在适当的方格上作出响应。如问卷预设的位置不敷应用，请另页填写。

香港交易所的建议 1： 修改香港交易所的压力测试假设

问题

1. 阁下 / 贵公司是否支持有关压力测试中所用的价格变动假设的修订建议？

☒ 同意

☐ 不同意

请说明原因，并提供任何其它相关建议或意见：

2. 阁下 / 贵公司是否支持压力测试中所用的对手失责假设的修订建议？

☒ 同意

☐ 不同意

请说明原因，并提供任何其它相关建议或意见：

香港交易所的建议 2： 推出香港结算按金制度及浮动保证金

问题

3. 阁下 / 贵公司是否同意香港结算推出按金制度的建议？



同意



不同意

请说明原因，并提供任何其它相关建议或意见：

4. 阁下 / 贵公司是否同意香港结算设立浮动保证金模式的建议？



同意



不同意

请说明原因，并提供任何其它相关建议或意见：

香港交易所的建议 3： 修改期货结算公司储备基金的计算方法

问题

5. 阁下 / 贵公司是否有关期货结算公司抵押品假设的修订建议？



同意



不同意

请说明原因，并提供任何其它相关建议或意见：

6. 阁下 / 贵公司是否支持设置「期货结算公司或然垫款」减轻结算参与者的负担？



同意



不同意

请说明原因，并提供任何其它相关建议或意见：

7. 阁下 / 贵公司对准许储备基金供款计入速动资金有甚么意见？这能否协助贵公司减低速动资金的经费负担？

_____ 同意准许储备基金供款计入速动资金

香港交易所的建议 4: 修改联交所期权结算所储备基金的计算方法

问题
8. 阁下 / 贵公司是否支持有关联交所期权结算所的抵押品假设的修订建议? ☒ 同意 ☐ 不同意 请说明原因, 并提供任何其它相关建议或意见: _____ _____ _____ _____ _____ _____ _____

其他意見:

目前, 结算所建议收取的按金和浮动保证基金都来自券商的自有资金。但由于客户买卖股票的交易直接影响券商需要交出的按金和浮动保证基金的金额, 建议从客户资金来承担一部分按金和浮动保证基金需求。

根据我司历史抽样数据, 每日的提款和交收金额之总和, 都不超过客户在我司资金余额的 5%, 客户资金中的至少 80%处于相对固定的状态, 因此建议从客户资金里抽出 10%-20%作为按金和浮动保证基金需求。

另外, 建议在改革实行后, 成立改革小组, 邀请业界人士参与, 可定期听取业界的意见, 了解改革后对业界的影响。