

HKEX

香港交易所

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)

編號
Ref. CD/CDCRM/217/2021

No.:

日期
Date: 27/07/2021

通告 CIRCULAR

事項: 保證基金的不定時檢討

查詢: 熱線 2979 7111

香港結算已就保證基金總額及每一結算參與者的所需供款作出不定時檢討。重新計算後，該保證基金總額在扣除浮動供款豁免額的總額後為三十九億六千萬港元。根據中央結算系統運作程序規則第 18.2.1 節，每一結算參與者的所需基本供款及浮動供款乃參照其於 2021 年 4 月 29 日至 2021 年 7 月 26 日期間的平均「每日持續淨額交收數額」的市場佔有率重新計算。

結算參與者可於 2021 年 7 月 27 日透過 CCASS 終端機下載「保證基金供款結單」(GFR608) 獲知其詳細的所需供款，全面結算參與者亦可同時下載「非結算參與者預測保證基金供款報告」(GFR616)。相應的款項將於 2021 年 7 月 28 日經直接記除指示或直接記存指示收取或歸還。

請注意，重新計算後的保證基金總額為四十一億七千萬港元。如果保證基金總額達到六十六億港元的保證基金限額，香港結算將向個別結算參與者收取保證基金風險抵押品，數額相等於結算參與者的潛在淨虧損扣除保證基金限額的 50%。結算參與者必須每天透過 CCASS 終端機下載「保證基金風險抵押品要求報告」(GFR806) 獲知其詳細的所需抵押品要求。相應的款項將於隨後的工作天經即時支付結算系統或直接記存指示收取或歸還。

如對上述資料有任何疑問，請致電熱線 2979 7111。

結算風險管理

高級副總裁

李麗儀 謹啟