

## 期貨結算所規則及程序

### 於期交所自動電子交易系統（「HKATS 電子交易系統」）內買賣的期貨／期權合約的結算所程序

## 第二章

### 交收程序

#### 2.6 提供結算所按金擔保的方法

結算所按金擔保是按本程序第 2.7 條所述透過直接扣除按金系統進行繳付。若任何合約的結算貨幣並非合約貨幣，期貨結算所於該等合約之結算所按金責任產生後，將在實際可行情況下，根據其認為適當的資料來源和基準所得之匯率盡快將該結算所按金責任兌換為等值之結算貨幣。期貨結算所參與者亦可以下文所述的一種或多種方式提供其結算所按金責任的擔保，但其每個共同抵押品管理系統抵押品戶口中用作擔保最少 50% 的結算所按金責任的結算貨幣現金必須不可以低於結算所指定的最低水平結算貨幣現金作擔保。一般而言，期貨結算所參與者的按金責任會首先以結算貨幣現金繳付，其次以期貨結算所不時批准的任何其他貨幣現金繳付，再者會以存放在期貨結算所參與者的共同抵押品管理系統抵押品戶口內的任何非現金抵押品繳付，或根據期貨結算所不時規定的任何運用次序繳付。

##### 2.6.3 認可的銀行擔保

期貨結算所參與者可以期貨結算所認可的持牌銀行及根據期貨結算所不時指定的形式所提供的一張或多張銀行擔保作為結算所按金責任的擔保。然而，期貨結算所可全權釐定以該形式作擔保的期貨結算所參與者結算所按金責任的最高金額。可用作擔保結算所按金責任的認可銀行擔保的價值，應是在持牌銀行所提供的銀行擔保中所註明的金額，並扣除期貨結算所按其不時釐定的百分率所計算的扣減。期貨結算所保留權利以便隨時增加或減小認可持牌銀行的數目，以及釐定每間持牌銀行可提供擔保的最高金額。因此，期貨結算所參與者於存入銀行擔保前必須先取得期貨結算所的批准。儘管有上述規定，若任何持牌銀行持有或控制（不論直接或間接）期貨結算所參與者 20% 或以上的已發行股本或投票權，或期貨結算所確切認為該持牌銀行與有關期貨結算所參與者有密切聯繫或關係，則期貨結算所將不會接納該持牌銀行提供的任何銀行擔保。在任何情況下，期貨結算所參與者如欲

採用銀行擔保，必須向期貨結算所發出最少一個銀行營業日的通知並透過共同抵押品管理系統終端機輸入存放指示。由於用作每日擔保的基準為結算貨幣現金，故以認可的銀行擔保作保證的所有結算所按金責任款項，均須繳付融通收費（見程序第 2.6.7 條）。

## 2.8 即日追收變價調整

根據上述進行的即日評估而作出的即日追收變價調整所產生的金額將不會記入期貨結算所參與者戶口。於任何其他情況，就每一種結算貨幣而言，若即日追收變價調整是在任何營業日的下午十二時三十分或之前作出，期貨結算所會於即日將因即日追收變價調整而產生的任何應貸記款項記入期貨結算所參與者戶口，但以下除外：(i) 若應記入的港元金額或根據結算所釐定的兌換率計算的非港元等值金額為1,000,000港元或以下；或 (ii) 若該即日追收變價調整所涉及的期交所合約的結算貨幣並非港元；或(iii) 若該款項是因實物交收合約於最後交易日後的即日追收變價調整所產生。任何上述須記入的款項會透過直接扣除按金系統，自動轉賬至期貨結算所參與者指定的直接扣除按金系統銀行戶口內。期貨結算所參與者須就此確保已向期貨結算所發出常設指示。

## 2.9 存入及發還外幣適用結算貨幣以外之認可貨幣的生效日

### 2.9.1 存入適用結算貨幣以外之認可貨幣外幣

在本程序2.9.1條及2.9.2條內所提及的「貨幣金額」是指由期貨結算所參與者在適用的情況下，存放於其共同抵押品管理系統抵押品戶口或其銀行戶口中，按程序2.6.2條及附錄V - (5)所列的認可貨幣金額，但不包括程序2.7條(a)所述的適用結算貨幣的任何金額；而「相關貨幣」則是指適用結算貨幣以外之認可貨幣。

將外幣任何貨幣金額由期貨結算所參與者的銀行戶口轉賬至期貨結算所在另一間銀行所開立的戶口所適用的生效日，通常是期貨結算所參與者的交收銀行收到期貨結算所參與者的轉賬指示當日的下一個（香港）銀行營業日。若該日為期貨結算所參與者的交收銀行或外幣相關貨幣結算所在國家的銀行假期，則生效日應為下一個（香港）銀行營業日及該日並非該國銀行假期，而該等款項亦不得用作繳付任何負債。只有在期貨結算所的交收銀行確認收到有關款項後，期貨結算所方會接納以該款項作為期貨結算所參與者的結算所按金責任及／或結欠款項的擔保。

若該期貨結算所參與者的戶口與期貨結算所的戶口均在同一銀行開設，則轉賬可於同一銀行營業日生效，而在該情況下外幣相關貨幣金額轉賬的生效日應是銀行收到期貨結算所參與者的轉賬指示的該銀行營業日。

### 2.9.2 發還外幣適用結算貨幣以外之認可貨幣

在本程序內，有關「貨幣金額」和「相關貨幣」的解釋與程序2.9.1條所述的相同。

期貨結算所參與者可於每個銀行營業日（星期一至星期五）上午十一時或之前，以書面或期貨結算所接納的任何其他方法通知期貨結算所，要求期貨結算所於每個（香港）銀行營業日（星期六除外）發還其存放於期貨結算所的外幣任何貨幣金額盈餘額。若期貨結算所按其絕對酌情權同意發還該外幣貨幣金額盈餘，則有關外幣貨幣金額盈餘會立即從該提出要求的期貨結算所參與者的共同抵押品管理系統抵押品戶口中扣除。然而，依程序2.9.2.1條及2.9.2.2條所述，發還的貨幣金額外幣不會於提出發還要求的同日生效，而在發還外幣之前，期貨結算所可能會在發還貨幣金額之前，就該貨幣金額外幣盈餘支付或收取按其不時根據當時銀行儲蓄利率釐定的正利率或負利率計算的有關利息。

#### 2.9.2.1 日元

發還日元的貨幣金額的生效日為期貨結算所收到發還要求當日後的第二個（香港）銀行營業日。若該日為日本的銀行假期，則生效日為下一個日本的銀行營業日。

#### 2.9.2.2 日元以外的貨幣金額其他外幣

發還任何日元以外的貨幣金額其他外幣的生效日為期貨結算所收到發還要求當日後的下一個（香港）銀行營業日。若該日為期貨結算所參與者的交收銀行或日元以外的相關貨幣結算所在國家的銀行假期，則生效日將為該國家的下一個銀行營業日。

附表 I

**利息及融通收費架構**

1. ~~港元／美元~~／認可貨幣

期貨結算所參與者應收或應付利息

以現金支付結算所按金	)	由期貨結算所不時
盈餘現金	)	根據當時的銀行儲
以現金支付額外按金	)	蓄利率釐定
	)	
以現金支付期貨結算所參與者額外供款	)	由期貨結算所不時
	)	釐定
	)	
	)	

附表 V

認可貨幣列表
--------

認可貨幣列表如下： -

1. 港元
2. 美元
3. 歐羅
4. 日元
5. 人民幣