

附表 I

利息及融通收費架構

1. 認可貨幣

期貨結算所參與者應收或應付利息、成本及收費

以現金支付結算所按金

盈餘現金

以現金支付額外按金

) **港元**
) 應付利息將按當時一個月香港
) 銀行同業拆息(HIBOR) 為基
) 準，按 0.5 倍及 0.25% 差價調
) 整。倘計算金額小於零，則應
) 付金額將設為零。

其他除港元外非負利率貨幣的認可貨幣

應付或應收之利率將不時按當時銀行儲蓄利率而計算。

其他除港元外負利率貨幣的認可貨幣

利息及徵收的成本將按 0.25% 差價加期貨結算所產生的任何成本(包括任何負收益，掉期成本和銀行收費)計算，並當期貨結算所收取正回報時可能有所下調。

以現金支付期貨結算所參與者額外供款

) 由期貨結算所不時按當時的儲
) 存利率釐定

2. 期貨結算所參與者應付融通收費

以外匯基金票據／債券／美國政府國庫票據及債券／其他非現金抵押品支付結算所按金

— 由期貨結算所不時全權決定

附表 II

(已刪除)

附表 III

(已刪除)

附表 IV

(已刪除)

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
6. 新加坡元