

中央結算系統運作程序規則

定義

(b) 除非內文另有所指，否則下列詞語運用於本運作程序規則時具有下列含義：

「應付額外現金抵押品報告」 指 結算公司發給結算參與者或結算機構參與者的報告，內載結算公司因應該參與者在「持續淨額交收」制度下的未交收股份數額對照其已分配速動資金的風險而計算需向其收取的現金抵押品詳情，見第10.11.4節及《參與者適用的中央結算系統終端機使用者指引》；

第十節

聯交所買賣 — 持續淨額交收制度

10.11.4 結算公司的通知

除第 10.10.11 節所述集中抵押金的收取除外，以及參考參與者已分配速動資金計算的抵押品（計算方法載於每個營業日結束時發給參與者的應付額外現金抵押品報告，結算公司將透過在中央結算系統港元款項交收程序中向參與者的指定銀行發出直接記除指示，又或以結算公司不時指示的其他方法或以合資格貨幣向參與者收取）以外，結算公司將以書面方式通知參與者其須提供的任何其他抵押品的款額，而參與者則須於指定的期間內提供抵押品。

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
<u>CRMAC01</u>	<u>應付額外現金抵押品報告</u>	<u>每日</u>	<u>額外現金抵押品處理程序完成後</u>