

期權買賣交易所參與者交易運作程序

9. 按金要求

9.5 用作交付按金的現金抵押品的利息、成本及收費

聯交所期權結算所會按其不時規定的正利率或負利率，及由該款項產生的成本和收費向用作支付按金的現金抵押品及其他現金存款支付或徵收利息、成本和收費（根據附錄I）。截至及包括月內最後一日為止所賺取或被徵收的利息、成本和收費總額，會於下一個月份的首個營業日在聯交所期權結算所參與者各自的共同抵押品管理系統抵押品戶口中記入或扣除。

10. 款項交收

10.4 交付／歸還現金程序

10.4.1 聯交所期權結算所參與者歸還現金程序

10.4.1.2 適用結算貨幣以外之認可貨幣

聯交所期權結算所參與者如欲要求歸還任何載於附錄 H 的認可貨幣現金，但不包括第 10.1 條所述的適用結算貨幣，則以下程序將適用：

- i. 聯交所期權結算所參與者應查核其共同抵押品管理系統抵押品戶口中是否有認可貨幣盈餘現金結餘；
- ii. 聯交所期權結算所參與者可於每個營業日（該營業日亦必須是聯交所期權結算所參與者的銀行所在及適用結算貨幣以外之認可貨幣結算國家的銀行營業日）上午十一時前以書面或聯交所期權結算所可接納的其他形式，通知聯交所期權結算所有意要求歸還發放任何提供予聯交所期權結算所的認可貨幣款項餘額；及
- iii. 若聯交所期權結算所全權決定接受該等款項餘額的歸還要求，則其會在實際可行情況下盡快處理，惟依以下 10.4.1.2(iii)(a)及(b)所述，款項餘額不會在歸還要求的同日發放。在歸還款項餘額之前，聯交所期權結算所可就該款項按正利率支付或負利率收取利息，並可能徵收由該款項產生的成本和收費，有關利率、成本和收費可由聯交所期權結算所不時根據附錄 I 釐定。歸還款項餘額的估值日如下：

附錄1. 利息及融通收費架構

利息及融通收費架構

1. 認可貨幣

應付或徵收聯交所期權結算所參與者的利息、成本和收費

<p>以現金支付的按金要求 除儲備基金供款外的現金</p>	<p>))))</p>	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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% 差價加聯交所期權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，並當聯交所期權結算所收取正回報時可能有所下調。</p>
<p>以現金支付的不定額儲備基金供款</p>	<p>))</p>	<p>由聯交所期權結算所不時按當時銀行存款息率釐定</p>

2. 聯交所期權結算所參與者應付的融通收費

<p>以證券抵押品／ 外匯基金債券／票據／ 其他非現金抵押品 支付的按金要求</p>	<p>—</p>	<p>由聯交所期權結算所不時酌情釐定</p>
--	----------	------------------------