

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)

通告 CIRCULAR

事項： 復活節假期前即日追收按金安排

查詢： 熱線 2979-7111

聯交所運作的證券市場將於2024年3月29日和4月1日休市。由於一些主要市場在此期間仍然開市，為確保妥善管理上述期間的市場風險，根據香港結算運作程序規則第10.10A.5節，香港結算將於 **2024年3月28日** 收取即日按金。結算參與者請注意以下有關安排：

即日按金的計算及收取

- 香港結算將於 **2024年3月28日約下午2時** 就所有待交收的持續淨額交收股份數額計算即日按金¹。除剔除到期及逾期交收的持續淨額交收股份數額的計算，即日按金計算與日終按金計算相同。
- 香港結算在追收即日按金時，只會向結算參與者收取不足的按金，並不會退回多於按金金額之現金。
- 結算參與者須於 **2024年3月28日下午5時45分前** 繳付即日按金的不足款項。香港結算將於2024年3月28日向結算參與者的指定銀行發出直接記除指示(DDI)收取即日按金的不足款額以作為中央結算系統款項交收程序的一部分，並透過「傍晚銀行同業大批交收程序」交收。

¹ 即日按金計算時也會重新計算和收取即日差額繳款

即日按金的款項責任

4. 於2024年3月28日即日按金程序完成後，以下的廣播訊息將於中央結算系統發放以通知結算參與者下載報告。

“Posting / Collateralisation Result Report for Intra-day Marks and / or Margin Collection is now available.”

5. 有關即日按金的款項責任，結算參與者可於2024年3月28日約下午2時45分從中央結算系統下載並參閱 Posting / Collateralisation Result Report (CCMPY01)²。

敬請各結算參與者與貴指定銀行安排所需資金，以便履行於2024年3月28日的即日按金款項責任。

香港結算特別提醒結算參與者於假期前後的日子，必須有適當的安排。如有主要員工因假期而缺席，請確保後備員工熟悉有關的營運與監控程序，使閣下能夠充分地監控風險及按時履行由香港結算所發出的款項責任。根據香港結算一般規則第3701條，結算參與者若不能於指定時限內履行由香港結算發出的款項責任將會構成失責事件。請參閱於2024年3月11日發出的通告（編號：[CD/CDCRM/061/2024](https://www.hkex.com.hk/CD/CDCRM/061/2024)），詳細了解有關結算參與者的款項責任以及延遲或不能履行款項責任的後果。

如對上述資料有任何查詢，請致電熱線 2979 7111。

結算及存管

副總裁

陳智浩 謹啟

² 有關即日按金的款項要求，結算參與者可於約下午2時30分從報表檢索平台檢索以下報告(i) MTM and Margin Requirement Report (RMAMR01) and (ii) MTM and Margin Requirement Report (Summary Version) (RMAMR03)