

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

香港交易及結算有限公司是《證券及期貨條例》所述的認可控制人，亦為香港聯合交易所有限公司、香港期貨交易所有限公司、香港中央結算有限公司、香港聯合交易所期權結算有限公司、香港期貨結算有限公司及香港場外結算有限公司的控制人。

Hong Kong Exchanges and Clearing Limited is a recognized exchange controller under the Securities and Futures Ordinance which is the controller of The Stock Exchange of Hong Kong Limited, Hong Kong Futures Exchange Limited, Hong Kong Securities Clearing Company Limited, The SEHK Options Clearing House Limited, HKFE Clearing Corporation Limited and OTC Clearing Hong Kong Limited.

### 指引

#### (A) 一般指引

1. 在填寫問卷前，請仔細閱讀並跟隨指示填寫問卷。
2. 請使用**Adobe Acrobat**打開和填寫問卷。
3. 請確保以問卷中下拉式選單及文字欄回答所有問題。
4. 如問卷的回答空間不足夠或希望提交額外資訊，請另附檔案加以補充並加以註明該補充資料所對應的問題。
5. 本問卷以以下列方式設計：
  - (a) 當問題 (A1) 的公司名稱一經被揀選，相對應的「參與者代號」及「客戶代號」將會被自動編排。如你其後選擇另一公司名稱，此表格將會被還原 (即所有之前填寫的答案將會被清除)。
  - (b) 所有必答題的下拉式選單及文字欄會以紅色邊框顯示。
  - (c) 如部分問卷不適用於貴公司，該部分將會以灰色覆蓋。
  - (d) 本問卷的某些問題會以你提供的回答去決定是否適用於貴公司。如有問題不適用於貴公司，問卷不會讓你該問題作答。如有問題不再適用於貴公司 (可能由於你更改了前面的回答而有所更新)，任何之前就該問題所提供的回答將會被清除。
6. 在儲存檔案時，如果有必須回答的問題尚未填寫，提示信息將會彈出。

#### (B) 準備提交文件

1. 如需提交補充資料作證明文件 (包括「呈交香港交易所的股權架構圖所涉及的補充資料表」("Supplementary Table associated with Shareholding Structure Chart provided to HKEX")(如適用))，請連同本表格一起以WinZip壓縮，並以同一個".zip"格式的壓縮檔案提交。
2. 請確保用作提交的壓縮檔內不存在其他壓縮檔或多層文件夾。
3. 壓縮文件檔案名應跟據以下格式設定：
  - (a) 第一組 (聯交所參與者、香港結算參與者及期權結算所參與者) - MSM01\_XXXXX\_YYYYMMDD.zip ; 或
  - (b) 第二組 (期交所參與者及期貨結算公司參與者) - MSM04\_XXXXX\_YYYYMMDD.zip ;當中 (i) XXXXX是e通訊用戶號碼第二至第六位的字符，和 (ii) YYYY、MM和DD分別是提交/重新提交的年、月及日。
4. 如需重新遞交問卷，請跟據上述 (B) 3 的檔案名格式命名。至於同日重覆遞交的檔案，e通訊將會根據版本數目自動更新檔案名稱。

#### (C) 以電子通訊平台 (「e通訊」) 遞交檔案

e通訊連接: <https://www.ecp.hkex.com.hk/logon.aspx?lang=zh-tw>

e通訊用戶使用指南: [https://www.ecp.hkex.com.hk/ECP\\_frontend\\_userguide\\_c.pdf](https://www.ecp.hkex.com.hk/ECP_frontend_userguide_c.pdf)

1. 你須使用有關用戶群的e通訊用戶號碼來登入e通訊提交壓縮檔案：
  - (a) 聯交所參與者或同時為聯交所及期交所的參與者 - Trading Operations (即TO) ;
  - (b) 香港結算參與者及與期權結算所參與者 - Self-Attestation of Compliance Questionnaire (即SA) ; 或
  - (c) 期交所參與者及期貨結算公司參與者 - Operations in Derivatives Market (HKFE products) (即DO)。
2. 登入後，在提交清單頁面請點選提交文件夾「合規評核」("Self-Attestation of Compliance Questionnaire") 的連接，閣下將被連接到遞交檔案的頁面。

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

3. 附上壓縮檔案，點擊「遞交」("Submit") 按鈕。e通訊系統在接納檔案前會進行核證。核證包括 ( 但不限於 ) 以下各項：
- (a) 提交未有逾期 ( 通告所列期限 ) ；
  - (b) 檔案名稱的格式正確；及
  - (c) 壓縮檔大小不超於4MB。
4. 如檔案獲接納，系統將會顯示確認頁面。
- 

### (D) 查詢

有關e通訊的查詢，請聯絡交易運作部：

[ecpadmin@hkex.com.hk](mailto:ecpadmin@hkex.com.hk)

有關問卷的查詢，請聯絡市場監察部：

[surveillance@hkex.com.hk](mailto:surveillance@hkex.com.hk)

---

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

### 概覽

除非另有界定，本問卷所用詞彙與以下(適用的)規則所載的涵義相同：

- 香港聯合交易所有限公司(「聯交所」)的交易所規則(「交易所規則」)、期權交易規則(「期權交易規則」)及期權買賣交易所參與者交易運作程序(「期權交易運作程序」)
- 香港期貨交易所有限公司(「期交所」)的期交所規則、規例及程序(「期交所規則」)
- 香港中央結算有限公司(「香港結算」)的中央結算系統一般規則(「中央結算系統規則」)及中央結算系統運作程序規則(「中央結算系統運作程序規則」)
- 香港期貨結算有限公司(「期貨結算公司」)的期貨結算所規則(「期貨結算公司規則」)及程序(「期貨結算公司程序」)
- 香港聯合交易所期權結算有限公司(「聯交所期權結算所」)的期權結算規則(「聯交所期權結算所規則」)及期權買賣交易所參與者結算運作程序(「聯交所期權結算所運作程序」)

### 一般資料

- (A1) **公司名稱**
- (A1a) 聯交所參與者代號
- (A1b) 股票期權交易所參與者代號
- (A1c) 期交所參與者代號
- (A1d) 香港結算參與者代號
- (A1e) 聯交所期權結算所參與者DCASS代號
- (A1f) 期貨結算所參與者DCASS代號
- (A1g) HKATS代號
- (A2) **聯絡人(關於此問卷)**
- (A2a) 姓名
- (A2b) 職位
- (A2c) 電話號碼(直線或手機號碼)
- (A2d) 電郵地址
- (A3) **負責人員1聯絡資料[註 1]/核心職能主管(整體管理監督)聯絡資料[註 2]**
- (A3a) 姓名
- (A3b) 職位
- (A3c) 電話號碼(直線號碼)
- (A3d) 電話號碼(手機號碼)
- (A3e) 電郵地址
- (A4) **負責人員2聯絡資料[註 1]**
- (A4a) 姓名
- (A4b) 職位
- (A4c) 電話號碼(直線號碼)
- (A4d) 電話號碼(手機號碼)
- (A4e) 電郵地址
- (A5) **負責交收程序職員的聯絡資料**
- (A5a) 姓名
- (A5b) 職位

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(A5c) 電話號碼(直線號碼)

(A5d) 電話號碼(手機號碼)

(A5e) 電郵地址

(A6) **負責資金調撥職員的聯絡資料**

(A6a) 姓名

(A6b) 職位

(A6c) 電話號碼(直線號碼)

(A6d) 電話號碼(手機號碼)

(A6e) 電郵地址

(A7) **負責合規職員的聯絡資料**

(A7a) 姓名

(A7b) 職位

(A7c) 電話號碼(直線或手機號碼)

(A7d) 電郵地址

---

(A8) **股權架構圖(只適用於結算所參與者 - 託管商參與者除外)**

請提供最新的 (1) 股權架構圖 (見附件一) 及 (2) 載有各實體持股詳情的資料表(見附件二)。有關填寫上述文件的指示及範本, 請參閱載於與本問卷同一壓縮檔案內的附件一及附件二。(如果貴公司只是託管商參與者, 請選擇「不適用」)

(A8a) 提交問卷時已附帶按有關指示製備的股權架構圖。

(A8b) 提交問卷時已附帶按有關指示製備的資料表。

(A8c) 根據香港結算規則第1703(viii)(b)條, 期貨結算公司規則第214A(ii)條及聯交所期權結算所規則第403F(2)條, 本問卷所提供的資料會用來作為給予期貨結算公司、香港結算或聯交所期權結算所的年度持股資料。

(A8d) 根據香港結算規則第1703(viii)(a)及(c)條, 期貨結算公司規則第214A(i)及(iii)條及/或聯交所期權結算所規則第403F(1)及(3)條, 本人明白當公司有股權架構重組、多於10%(直接或間接)股本變更或投票權變動, 須盡快(通過電郵 ClearingCreditRisk@hkex.com.hk) 向相關結算所提供已更新之股權架構圖。

(A8e) 於過去12個月, 股權架構圖曾有變更?

(A8f) 如(A8e)答案為「是」, 變更是否(直接或間接)涉及股本或投票權的35%或以上的轉變?

---

(A9) **組織結構圖(只適用於結算所參與者 - 託管商參與者除外)**

請提供最新的組織結構圖, 當中包括主要功能部門、向董事會及管理層匯報流程, 並請確認(如果貴公司只是託管商參與者, 請選擇「不適用」) -

(A9a) 提交問卷時已附帶組織結構圖, 並且檔案名稱由以下資料順序組成: 先以「Key functions and staff」為首, 然後是參與者代號及/或DCASS代號, 最後是股權架構圖的資料日期(例如「Key functions and staff B09999 and CZZZ 07Jan2021.pdf」)。

(A9b) 所有涉及結算、交收及風險管理之部門(包括由控股及附屬公司提供服務之部門)已被列於組織結構圖。

(A9c) (1)所有部門主管、負責人員及管理層及(2)所有董事會成員之姓名已被列於組織結構圖。

公司補充資料

(A9d) 於過去12個月, 組織結構圖曾有變更?

(A9e) 如(A9d)答案為「是」或「不適用」, 請提供補充資料\*。

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(A9f) 是否有管理層或董事會成員在貴公司擔任其他職務?(除(A9b)所述的職務)

(A9g) 如(A9f)答案為「是」或「不適用」,請提供補充資料\*。

---

### 程式買賣 (只適用於聯交所及期交所參與者)

(A10) 在過去 12 個月內,貴公司是否採用程式買賣系統/技術來發出和執行在交易所上市的證券或衍生品交易的買賣指示?

一般而言,程式買賣是指根據預定參數和規則自動執行訂單的電子計算機化交易系統。

如(A10)的回答為「是」,請回答(A11)至(A26)。

(A11) 請說明貴公司在哪些市場的交易活動上採用了程式買賣系統或技術(“程式買賣活動”)(例如:股票市場、期貨市場、期權市場、交易所買賣基金市場、固定收益市場或其他;如選其他,請說明)\*。

(A12) 請說明貴公司在程式買賣活動上的交易身份。

(A12a) 

- 僅限自營交易

(A12b) 

- 僅限代客交易

(A12c) 

- 自營交易及代客交易

(A13) 請說明貴公司採用的程式買賣系統的來源。

(A13a) 

- 內部研發

(A13b) 

- 第三方供應商

(A13c) 

- 其他

(A13d) 如(A13b)及/或(A13c)的回答為「是」,請詳細說明\*。

(A14) 請說明貴公司採用的買賣程式的來源。

(A14a) 

- 內部研發

(A14b) 

- 客戶通過直接市場准入進行交易

(A14c) 

- 第三方供應商

(A14d) 

- 其他

(A14e) 如(A14c)及/或(A14d)的回答為「是」,請詳細說明\*。

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

- (A15) 請詳細說明貴公司採用的程式買賣策略 (例如: 成交量百分比、成交量加權平均價格、時間加權平均價格、流動性尋求算法、到貨價算法、黑池交易等)。
- (A16) 在過去12個月內, 貴公司是否在發出和執行聯交所上市證券或衍生品交易訂單時採用高頻交易?  
一般來說, 高頻交易是指程式買賣的一個子部分, 它以極快的速度 (從微秒到納秒) 交易證券, 同時在當天的盤中維持較少的持倉。
- (A17) 請說明貴公司在哪些市場採用了高頻交易 (例如: 股票市場、期貨市場、期權市場、交易所買賣基金市場、固定收益市場或其他; 如選其他, 請說明)\*。
- (A18) 請說明貴公司在高頻交易活動上的交易身份。
- (A18a)
  - 僅限自營交易
- (A18b)
  - 僅限代客交易
- (A18c)
  - 自營交易及代客交易
- (A19) 貴公司是否有適當的監控安排以確保 (a) 參與設計及開發; 或 (b) 獲核准使用其程式買賣系統及買賣程式的人士具備合適的資格?
- (A20) 貴公司是否有適當的監控安排, 以防止未經授權進入其買賣程式?
- (A21) 貴公司是否有適當的監控安排, 以確保其使用或提供予客戶使用的程式買賣系統及買賣程式均經過充分測試, 以確保它們按設計運作。
- (A22) 貴公司是否有適當的監控安排, 以確保對其買賣程式的修改遵循適當的監控變更管理程序?
- (A23) 貴公司是否有適當的安排 (涵蓋其使用或提供給客戶使用的程式買賣和買賣程式) 以確保其程式買賣系統及買賣程式以有利市場廉潔穩健的方式運作 (例如防止向市場傳送錯誤買賣指示)?
- (A24) 貴公司是否有適當的安排 (涵蓋其使用或提供給客戶使用的程式買賣和買賣程式), 使其在有需要時可: (a) 即時制止系統產生及向市場傳送錯誤買賣指示; 及(b) 取消市場上任何尚未執行的買賣指示。
- (A25) 請具體說明與使用程式買賣 (包括高頻交易) 系統和技術相關的風險 (例如價格和數量或其他交易前監控、發出買賣指示、轉發買賣指示和在緊急情況下取消買賣指示)\*。
- (A26) 如(A19)至(A24)有任何一題的回答為「否」, 請詳細說明\*。

---

(A27) **錯誤交易處理 (只適用於聯交所及期交所交易所參與者)**

(A27a) 過去 12 個月內是否發生過任何錯誤交易?

如(A27a)的回答為「是」, 請回答(A27b)至(A27c)。

(A27b) 該些錯誤交易是否已向相關交易所作出報告?

(A27c) 請就該些錯誤交易提供補充資料, 包括但不限於發生錯誤交易的根本原因, 以及防止其再次發生的措施\*。

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

- (A27d) 貴公司是否有適當的監控措施，以確保能及時識別錯誤交易？
- (A27e) 貴公司是否有適當的程序，以確保錯誤交易在識別後能及時向相關交易所作出報告？
- (A27f) 如(A27d)及/或(A27e)的回答為「否」，請詳細說明。

---

(A28) **聲明**

本人聲明，我們在本問卷所提供的資料（包括證明文件（如有）中提述的所有資料）均屬完整、真實及正確。我們並沒有任何陳述或遺漏，而致令資料不真實或具誤導成份。

- (A28a) 負責人員姓名：
- (A28b) 職位：
- (A28c) 日期 (dd/mm/yyyy)：

---

**個人資料收集聲明**

香港交易及結算所有限公司以及其不時的附屬公司（統稱「本集團」）（在本私隱政策聲明中，各自稱為「香港交易所」、「我們」或「本集團成員公司」，視適用情況而定）明白根據香港法例第486章《個人資料（私隱）條例》其在收集、持有、處理、使用及 / 或轉移個人資料方面的責任。個人資料的收集只限作合法且相關的用途，並會採取一切實際可行方法去確保我們持有的個人資料準確無誤。我們將會根據本私隱政策聲明使用我們不時所收集閣下的個人資料。香港交易所的私隱政策聲明載於香港交易所的網站：[http://www.hkex.com.hk/chi/global/privacy\\_policy\\_c.htm](http://www.hkex.com.hk/chi/global/privacy_policy_c.htm)

---

[註 1]: 若參與者同時為《證券及期貨條例》內所指的註冊機構，請提供主管人員的聯絡資料。

[註 2]: 若參與者同時為《證券及期貨條例》內所指的註冊機構，請提供行政總裁或首席運營官的聯絡資料。

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

### 第一部分 - 中華通證券交易 (上海 / 深圳)

(此部分只適用於聯交所的交易所參與者)

交易所參與者資格

交易所參與者名稱

審查年度

#### 就此調查問卷

自營交易

指以參與者公司自己的賬戶進行交易。

代理交易

指代參與者公司的客戶進行交易，包括透過該參與者母公司或姐妹公司進行的客戶交易。

(B1) 在本審查年度期間，貴公司是否有進行以下中華通證券的北向交易：

(B1a) • 代理交易

(B1b) • 自營交易

(B2) 在本審查年度期間，貴公司是否登記為：

(B2a) • 中華通交易所參與者("CCEP")

(B2b) • 透過中華通交易所參與者買賣之交易所參與者 (即Trade-through China Connect Exchange Participant, "TTEP")

以下部分只適用於就(B2a)或(B2b)回答「是」的交易所參與者。

(B3) 遵守相關法律和聯交所規則

就《交易所規則》第1432至1434條，及第14A10和14B10條有關遵守中華通證券交易的法律及規例而言，

(B3a) 貴公司是否有專責的人士，合規和/或法律部門以確保貴公司了解及遵守中華通服務及買賣中華通證券的相關法律、規則及規例？

(B3b) 根據第14A10(1)和14B10(1)條，貴公司是否遵守及有適當的安排以提醒客戶遵守上交所/深交所規則以及中國內地有關使用中華通服務及買賣中華通證券的法律及規例？

(B3c) 根據第14A10(2)和14B10(2)條，貴公司是否有向客戶充分披露投資中華通證券的相關風險？

(B3d) 根據規則第14A10(3)至(7)和第14B10(3)至(7)條，貴公司是否有確認及有適當安排以獲得客戶有關中華通證券的確認？

(B3e) 貴公司是否有進行交易監察和監控以偵測潛在的市場不當行為和違反有關買賣中華通證券相關交易規例的情況？

(B3f) 如(B3a)至(B3e)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

(B4) 每日額度 / 回轉交易 / 前端監控 / 非交易過戶 / 碎股

貴公司是否有遵守以下的《交易所規則》：

(B4a) • 買賣中華通證券的額度 (規則第1428條)

(B4b) • 回轉交易 (規則第14A06(4)及14B06(5)條)

(B4c) • 前端監控 (規則第1421(2)、1424、14A06(2A)、(2B)、(5)至(10)及14B06(3)、(3A)、(6)至(12)條)

(B4d) • 非交易過戶 (規則第14A12及14B12條)

(B4e) • 碎股 (規則第14A06(3)及14B06(4)條)

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

- (B4f) 如(B4a)至(B4e)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。
- (B4g) 就規則第1428條有關買賣中華通證券的額度而言，貴公司是否有有效的前端監控以防止惡意搶佔額度的行為？
- (B4h) 就規則第14A06(4)及14B06(5)條有關禁止回轉交易而言，貴公司是否有適當安排以確保貴公司或貴公司客戶不會於同日出售當天購入的中華通證券（不論以主事人或代理人身份）？
- (B4i) 就規則第1421(2)、1424、14A06(5)至(10)及14B06(6)至(12)條有關前端監控而言，貴公司是否有適當安排以確保貴公司或貴公司客戶在沽盤時持有足夠證券/輸入買盤時有足夠資金以履行交收責任？
- (B4j) 就規則14A06(2A)和14B06(3)條有關特別獨立戶口買賣盤而言，貴公司是否有足夠的監控措施以確保在向中華證券通系統輸入特別獨立戶口買賣盤前準確地輸入特別獨立戶口投資者識別編號？
- (B4k) 就規則14A06(2B)和14B06(3A)條有關SPSA 集中管理買賣盤而言，貴公司是否有足夠的監控措施以確保在向中華證券通系統輸入SPSA 集中管理買賣盤前準確地輸入SPSA 集中管理戶口投資者識別編號？
- (B4l) 就規則14A06(2B)和14B06(3A)條有關SPSA 集中管理買賣盤而言，貴公司是否有足夠的監控措施以確保在向中華證券通系統輸入SPSA 集中管理買賣盤前已獲該SPSA 集中管理賬號持有人就相關中華通證券作出的預先分配指示？
- (B4m) 就規則第14A12及14B12條而言，貴公司是否有足夠的監管措施以確保所有非交易過戶必須按照規則第14A12(2)及14B12(2)條所允許的進行？
- (B4n) 貴公司是否有充足的政策及程序以說明錯誤交易處理和說明規則第14A12(2)及14B12(2)條下允許的非交易過戶？
- (B4o) 貴公司是否有適當程序以按照規則第14A12(3)和14B12(3)條向交易所報告貴公司與客戶之間為修正錯誤交易而進行的非交易過戶的詳情？
- (B4p) 就規則14A06(3)和14B06(4)條有關碎股而言，貴公司是否有足夠的監控措施以確保涉及碎股的中華通買賣盤以及涉及出售貴公司或客戶所持中華通證券的部分碎股的中華通沽盤是不允許的？
- (B4q) 如(B4g)至(B4p)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

### (B5) 持股量限制 / 披露責任

貴公司是否有遵守以下的《交易所規則》：

- (B5a) • 境外投資者持股限制（規則第14A08(2)至(3)及14B08(2)至(3)條）
- (B5b) • 強制出售程序（規則第14A08(5)至(8)及14B08(5)至(8)條）
- (B5c) • 有關中華通證券的披露責任（規則第14A09條及14B09條）
- (B5d) 如(B5a)至(B5c)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。
- (B5e) 就規則第14A08(2)及14B08(2)條有關境外投資者持股限制而言，貴公司是否有提供足夠資源及適當安排以確保合規及提醒客戶遵守10%個人境外投資者的持股限制？
- (B5f) 就規則第14A08(3)及14B08(3)條有關境外投資者持股限制而言，貴公司是否有適當安排以確保合規及提醒客戶有關30%總持股限制及相關強制出售安排？
- (B5g) 就規則第14A08(5)至(8)及14B08(5)至(8)條有關強制出售程序，貴公司是否有適當的措施（包括與客戶訂立可依法執行強制出售的客戶協議）確保能夠及時執行強制出售安排？

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

- (B5h) 就規則第14A09及14B09條有關中華通證券的披露責任，貴公司是否有適當安排以確保合規及提醒客戶有關5%持股量披露規定？
- (B5i) 如(B5e)至(B5h)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

### (B6) 保證金交易

- (B6a) 貴公司是否有進行中華通證券的保證金交易？
- (B6b) 貴公司有否清晰知會客戶所提供的服務範圍有否包括有關中華通證券的保證金交易及（如適用）相應的條款和條件？
- (B6c) 如(B6b)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

如(B6a)的回答為「是」，請回答(B6d)至(B6i)。

- (B6d) 貴公司是否有遵守規則第14A15及14B15條中有關中華通證券保證金交易的規定？
- (B6e) 貴公司是否有適當監控措施，以確保客戶不可憑藉其戶口內所有證券的抵押總值購買未列入可進行保證金交易的合資格上交所/深交所證券名單中的中華通證券？
- (B6f) 就規則第14A15(2)及14B15(2)條有關中華通證券的保證金交易，貴公司是否有適當監控措施，以確保只會為聯交所公佈可進行保證金交易的合資格證券進行保證金交易？
- (B6g) 貴公司是否有適當安排以確保輸入涉及保證金交易的中華通買盤，均能符合規則第14A15(4)至(5)及14B15(4)至(5)條所載的限制及規定？
- (B6h) 就規則第14A15(7)及14B15(7)條，貴公司是否有適當安排以確保客戶知悉及了解有關中華通證券保證金交易的限制、規定及條件？
- (B6i) 如(B6d)至(B6h)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

### (B7) 股票借貸活動

- (B7a) 貴公司是否有進行中華通證券的股票借貸活動？
- (B7b) 貴公司有否清晰知會客戶所提供的服務範圍有否包括中華通證券的股票借貸活動及（如適用）相應的條款和條件？
- (B7c) 如(B7b)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

如(B7a)的回答為「是」，請回答(B7d)至(B7j)。

- (B7d) 貴公司是否有遵守規則第14A16及14B16條有關中華通證券股票借貸的規定？
- (B7e) 貴公司是否有向交易所提供規則第14A16(10)至(11)及14B16(10)至(11)條所述的承諾書或確認書？
- (B7f) 貴公司是否有適當程序或審批程序以確保股票借貸活動是按照規則第14A16(2)至(3)及14B16(2)至(3)條所訂明的目的進行？
- (B7g) 貴公司是否有適當程序及檢查以確保股票借貸活動遵照規則第14A16(4)至(6)及14B16(4)至(6)條進行？
- (B7h) 貴公司是否有足夠資源及適當安排以確保遵守規則第14A16(12)及14B16(12)條，按時向交易所呈交每月報告？
- (B7i) 就規則第14A16(13)及14B16(13)條，貴公司是否有適當安排以確保客戶了解及知悉有關中華通證券股票借貸的限制、規定及條件？

**2022合規評核及現場視察之年度計劃  
合規評核問卷**

---

(B7j) 如(B7d)至(B7i)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

**(B8) 證券賣空**

(B8a) 貴公司是否有進行中華通證券賣空交易？

(B8b) 貴公司有否清晰知會客戶所提供的服務範圍有否包括中華通證券賣空交易及（如適用）相應的條款和條件？

(B8c) 如(B8b)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

如(B8a)的回答為「是」，請回答(B8d)至(B8m)。

(B8d) 貴公司是否有遵守規則第14A17及14B17條有關中華通證券賣空的規定？

(B8e) 貴公司是否有適當安排以確保只會為聯交所公布可賣空的合資格證券進行賣空？

(B8f) 貴公司是否有適當安排以確保賣空盤已準確標示並遵守有關賣空價格限制？

(B8g) 貴公司是否有適當監控及程序以確保自營交易的賣空符合規則第14A17(13)(b)及14B17(13)(b)條的規定？

(B8h) 貴公司是否有適當安排以確保已獲得客戶確認該買賣盤為賣空盤，並妥善保存確認紀錄？

(B8i) 為客戶輸入中華通證券賣空盤前，貴公司是否有適當監控及程序以確保遵守規則第14A17(13)(a)(i)至(iv)及14B17(13)(a)(i)至(iv)條的規定？

(B8j) 貴公司若知道或被告知輸入系統的買賣盤為賣空盤，貴公司是否有適當方法以確保把賣空指示轉達給其他有權使用系統的人士時，有告知他該指示屬賣空指示？

(B8k) 貴公司是否有充足資源及適當安排，以確保履行規則第14A17(17)至(20)及14B17(17)至(20)條的申報規定？

(B8l) 就規則第14A17(27)及14B17(27)條，貴公司是否有適當安排以確保有意進行中華通證券賣空的客戶了解及知悉有關賣空的限制、規定及條件(包括賣空價格限制)？

(B8m) 如(B8d)至(B8l)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

**(B9) 深交所創業板股份買賣及 / 或上海科創板股份買賣**

(B9a) 貴公司是否有進行深交所創業板股份及 / 或上海科創板股份買賣？

如(B9a)的回答為「是」，請回答(B9b)至(B9f)。

(B9b) 就規則第14B06(18)及14A06(15)條，貴公司是否有適當安排以確保直接客戶是機構專業投資者，才接受其購買深交所創業板股份及 / 或上海科創板股份的指示？

(B9c) 貴公司是否定期審視其客戶是否機構專業投資者？

(B9d) 就規則第14B06(18)及14A06(15)條，貴公司是否有適當以要求中介客戶確保僅機構專業投資者可買入深交所創業板股份及 / 或上海科創板股份？

(B9e) 貴公司是否定期對所有客戶(包括中介客戶的最終客戶)進行定期和適當的交易後檢查以確保遵守買賣深圳創業板股份及上海科創板股份的投資者資格規定？

**2022合規評核及現場視察之年度計劃  
合規評核問卷**

(B9f) 如(B9b)至(B9e)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

**(B10) 券商客戶編碼 (即BCAN)**

(B10a) 貴公司有否遵守《交易所規則》第1425A條有關券商客戶編碼的規定？

(B10b) 如問題(B10a)的回答是「否」，請提供補充資料解釋\*。

貴公司是否有適當程序，確保遵守《交易所規則》第1425A(1)條有關編派券商客戶編碼的規定，包括但不限於：

(B10c) • 為每名北向交易投資者戶編派一個唯一的券商客戶編碼

(B10d) • 依據開立賬戶的安排，編派券商客戶編碼予基金或基金經理客戶

(B10e) • 編派券商客戶編碼予聯屬公司的客戶

(B10f) • 券商客戶編碼的編制方式不應與客戶的身份有任何明顯的聯繫 (例如，券商客戶編碼不應由貴公司為客戶所編制的賬號或賬號其中一部分組成)

(B10g) 貴公司是否有適當安排，確保按《交易所規則》第1425A(2)條規定呈交券商客戶編碼與客戶識別信息配對文件？

(B10h) 貴公司是否定期檢視券商客戶編碼與客戶識別信息配對文件，確保配對文件內的數據準確和最新的？

(B10i) 貴公司是否有適當方法，確保在輸入中華通買賣盤時已按《交易所規則》第1425A(4)條載入正確的券商客戶編碼？

(B10j) 貴公司是否有適當安排，確保公司已取得《交易所規則》第1425A(5)條規定的所需授權及同意？

(B10k) 如未能取得所需授權及同意，又或所需授權及同意無效或不足，貴公司是否有適當方法確保只可為相關客戶輸入中華通買賣盤？

(B10l) 貴公司是否有適當監控措施及程序，按《交易所規則》第1425A(7)條的規定更正券商客戶編碼？

(B10m) 如(B10c)至(B10l)有任何一題的回答為「否」或「不適用」，請提供補充資料解釋\*。

**(B11) 其他**

(B11a) 貴公司是否有適當安排以確保，如適用，當貴公司的中介經紀客戶同時為交易所參與者並為其客戶進行買賣中華通證券時，其在開戶時及往後均已註冊為 TTEP？

(B11b) 貴公司是否有定期檢討中華通證券北向交易相關的政策、程序及資源分配？

(B11c) 如(B11b) 的答案為「是」，請說明檢討頻次。

(B11d) 貴公司是否有妥善程序以確保可及時向相關交易所及/或結算所申報違規情況？

(B11e) 貴公司是否有適當的上報程序及營運風險管理框架採取補救及預防措施？

(B11f) 貴公司是否有為參與中華通證券買賣業務的員工提供適當及充足的在職培訓以外的培訓？

(B11g) 如(B11a)至(B11b), (B11d)至(B11f)有任何一題的回答為「否」或「不適用」，請提供補充資料解釋\*。

\*如問卷的回答空間不足夠，請另附補充文檔並加以註明；有關如何呈交補充文檔，詳情請參照「指引」的B部。

**2022合規評核及現場視察之年度計劃  
合規評核問卷**

**第二(甲)部分 - 風險管理 (I)**

(此部分只適用於

- (i) 香港結算的直接結算參與者、全面結算參與者及託管商參與者;
- (ii) 期貨結算公司的結算參與者及全面結算參與者;及
- (iii) 聯交所期權結算所的直接結算參與者及全面結算參與者)

結算所

結算參與者或託管商參與者名稱

審查年度

(C1) 貴公司在審查年度內是否曾為以下結算所參與者?

- (C1a) • 香港結算(直接結算參與者及全面結算參與者)
- (C1b) • 香港結算(託管商參與者)
- (C1c) • 期貨結算公司(直接結算參與者及全面結算參與者)
- (C1d) • 聯交所期權結算所(直接結算參與者及全面結算參與者)

如(C1a)的答案為「是」，方須填寫所有第二(甲)部分和第二(乙)部分(D1)至(D4)的問題。

如(C1b)的答案為「是」，方須填寫所有第二(乙)部分(D3)的問題。

如(C1c)的答案為「是」，方須填寫所有第二(甲)部分和第二(丙)部分(E1)至(E7)的問題。

如(C1d)的答案為「是」，方須填寫所有第二(甲)部分和第二(丙)部分(E1)至(E3)及(E5)至(E6)的問題。

(C2) 機構狀況更新(自審查年度起至今) - 適用於結算參與者

- (C2a) 貴公司的股份有否被用作控股公司借款的抵押品?
- (C2b) 是否有人已提出呈請、展開相關程序、作出相關命令、通過任何有效決議、或已採取其他相關行動對貴公司進行清盤、重組、改造、合併或解散?
- (C2c) 是否有已委任臨時清盤人、清盤人、接管人或其他相關人士在接管全部或部份貴公司的業務或資產?
- (C2d) 總職員人數(業務經理除外)
- (C2e) 如問題(C2a)至(C2c)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料\*。

(C3) 業務資料 - 適用於結算參與者

- (C3a) 貴公司可有在審查年度內或之後才開展以下任何一項新業務?(1)中華通北向交易;(2)證券融資;(3)股票借貸;(4)自營買賣

如問題(C3a)的回答為「是」，請回答問題(C3b)和(C3c)。

- (C3b) 貴公司在開展(C3a)提及的新業務時，是否有根據中央結算系統規則第1703(iii)條、期貨結算公司規則第214(n)條或聯交所期權結算所規則第403(17)條，通知香港結算/期貨結算公司/聯交所期權結算所新業務的相關運作細節及風險控制?
- (C3c) 如問題(C3b)的回答為「否」，請解釋為何在參與相關業務前並無通知香港結算/期貨結算公司/聯交所期權結算所\*。

(C4) 管理層監督(風險管治及政策制定) - 適用於結算參與者

- (C4a) 是否有設立風險委員會使管理層能夠監督公司之風險管理事宜?
- (C4b) 如問題(C4a)的回答為「是」，該風險委員會至少多久舉行一次會議?

**2022合規評核及現場視察之年度計劃  
合規評核問卷**

---

(C4c) **貴公司是否具有涵蓋以下運營和風險控制程序的政策？ [註3]**

- 可符合及履行結算所財務要求及支付責任
- 在客戶失責事件期間管理資金及支付責任
- 管理系統權限
- 保證金系統及計算 (如適用)
- 有關持續淨額交收數額及抵押品要求的支付責任 (如適用)

(C4d) **如問題(C4a)或(C4c)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。**

---

(C5) **資金調撥及授權 - 適用於結算參與者**

(C5a) 所有貴公司用作結算的指定銀行戶口於審查年度內是否操作正常(即沒有在年度內曾經被凍結或成為不動賬戶)？

(C5b) 在貴公司用作結算的指定銀行戶口中，有沒有戶口在三個月或以上並無任何交易？

(C5c) 如問題(C5b)的回答為「是」，貴公司有否採取任何措施 (例：定期進行調撥測試) 以保持該等賬戶正常操作？

(C5d) 集團公司或股東從公司提取資金時，是否需要獲得不代表集團公司或股東利益的董事的批准？

(C5e) 集團公司或股東從公司提取資金時，是否需要獲得負責人員 (RO)的批准？

(C5f) 貴公司有否開通電子銀行服務(或如果貴公司為銀行集團的一部份，透過貴公司或集團財資部進行即時匯款)並具備能力可即時在(1)貴公司的賬戶(包括公司賬戶和客戶賬戶)與用作結算的指定銀行戶口之間作資金調撥和(2)資金作貨幣兌換？

(C5g) 貴公司是否將百分之八十或以上的公司或客戶資金置於與用作結算款項賬戶交收的同一銀行內？

(C5h) 貴公司有否開通電子銀行服務並具備足夠轉賬乎第三方授權可即時將貴公司的主要銀行賬戶與香港結算銀行賬戶之間作資金調撥[註 4]？(僅適用於香港結算的直接結算參與者和全面結算參與者。如果貴公司並非以上參與者，請選擇「不適用」)

(C5i) **如問題(C5a)、(C5c)至(C5h)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。**

---

(C6) **特定風險控制(全面結算參與者) - 適用於結算參與者**

(C6a) 貴公司是否為香港結算、期貨結算公司或聯交所期權結算所的全面結算參與者？

**如問題(C6a)的回答為「是」，請回答問題(C6b)至(C6o)。**

(C6b) 貴公司是否有訂立政策以設定用於審批新非結算參與者及進行信用評估過程中所使用的標準？

(C6c) 貴公司是否有訂立政策來決定非結算參與者的交易限額和 / 或持倉限額的制訂，以及相關的控制措施與監控流程？

(C6d) 貴公司是否有針對其非結算參與者的保證金政策和監控程序，涵蓋不同市場條件的保證金和收款，以及可接受的抵押品和估值的類型？

(C6e) 若有非結算參與者違約，貴公司是否有程序以處理其餘下持倉及就違約通知結算所？

(C6f) 當貴公司或其非結算參與者打算終止結算協議，貴公司是否有終止協議包括通知結算所的相應程序？

(C6g) **如問題(C6b)至(C6f)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。**

(C6h) 貴公司是否同時為(1)聯交所參與者及香港結算全面結算參與者;或(2)期交所參與者及期貨結算公司結算全面參與者;或(3)聯交所股票期權交易所參與者及聯交所期權結算所全面結算參與者？

---

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

如問題(C6h)的回答為「否」，請回答問題(C6i)至(C6k)。

(C6i) 當有客戶違約，是否有第三方交易所參與者或貴公司的關聯公司可以提供任何支援協助組合平倉？

(C6j) 是否有程序以評估、審查和監控該第三方交易所參與者或貴公司的關聯公司的信譽？

(C6k) 如問題(C4i)或(C4j)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

(C6l) 貴公司是否有向集團內或關聯公司以外的實體提供結算服務(例如基金公司或業內的其他經紀)?

(C6m) 貴公司是否打算(或繼續)向集團內或關聯公司以外的實體提供結算服務(例如基金公司或業內的其他經紀)?

(C6n) 如問題(C6l)或(C6m)的回答為「是」，請提供貴公司現時對非結算參與者客戶的收費結構。如果資料已以附件形式提供，請回答「見附件」\*。

(C6o) 除了清算服務以外，貴公司是否亦有向非結算參與者客戶提供信貸服務？

---

(C7) **特定風險控制(自營交易業務) - 適用於結算參與者**

(C7a) 貴公司有否從事自營交易業務？

如問題(C7a)的回答為「是」，請回答問題(C7b)至(C7h)。

(C7b) (1)高收益債券、(2)私募股權工具、(3)高槓桿投資和(4)場外衍生工具於審查年度末的投資總和是否超過流動資金的20%？

(C7c) 請提供在自營交易業務內容許投資的金融產品種類及各自所佔持倉百分比(於審查年度末)。

(C7d) 貴公司有否使用自營交易風險限額控制自營交易活動的風險？

(C7e) 貴公司有否採用止蝕機制以控制自營交易活動的風險？

(C7f) 貴公司有否進行損失分析(例如: 壓力測試)以了解自營交易組合在極端但可能的情況下的潛在損失？

(C7g) 如貴公司自營交易的限額被充分使用，請註明潛在損失(以流動資金的百分比表示)。

(C7h) 如問題(C7d)至(C7f)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

\*如問卷的回答空間不足夠，請另附補充文檔並加以註明；有關如何呈交補充文檔，詳情請參照「指引」的B部。

[註 3]：相關政策指引參考見《參與者及交易權申請之解釋說明》附件2。

[註 4]：香港結算已開立賬戶的銀行包括中國銀行(香港)有限公司、香港上海滙豐銀行有限公司、中國工商銀行(亞洲)有限公司、渣打銀行(香港)有限公司及華僑永亨銀行有限公司。帳戶的最新列表可參考香港結算於2020年10月8日發出之通告CD/CDCO/CCASS/038/2020附件一 [https://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Circulars-and-Notices/Participant-and-Members-Circulars/HKSCC/2020/cc\\_HKSCC\\_SET\\_Chi\\_038\\_2020.pdf](https://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Circulars-and-Notices/Participant-and-Members-Circulars/HKSCC/2020/cc_HKSCC_SET_Chi_038_2020.pdf)

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

### 第二(乙)部分 - 風險管理 (II)

(此部分只適用於香港結算的直接結算參與者、全面結算參與者及託管商參與者)

結算所

結算參與者或託管商參與者名稱

審查年度

---

#### (D1) 風險限額控制(現貨業務) - 適用於香港結算的結算參與者

(D1a) 貴公司會否容許尚未有足夠結算現金到賬的客戶落盤？

如問題 (D1a) 的回答為「是」，請回答問題(D1b)至(D1e)。

(D1b) 對於不需要在落盤前提供足夠結算現金的客戶(只限於以「貨銀對付」(DVP)方式於 T+2日證券交收的客戶)，貴公司是否有設下客戶風險限額(交易限額)以控制客戶層面的T+2結算風險？

(D1c) 對於不需要在落盤前提供足夠結算現金的客戶(非「貨銀對付」(DVP)客戶)，貴公司是否有使用客戶風險限額(交易限額)以控制客戶層面的結算風險？

(D1d) 在授予(D1b)或(D1c)所提及的風險限額後，貴公司有否定期檢討該限額水平？

(D1e) 如問題 (D1b) 至(D1d)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

#### (D2) 風險限額控制(證券融資業務) - 適用於香港結算的結算參與者

(D2a) 貴公司有否從事證券融資業務？

如問題 (D2a) 的回答為「是」，請回答問題(D2b)及(D2c)。

(D2b) 現時貴公司的證券保證金融資政策及實行情況有否完全符合證監會《證券保證金融資活動指引》？

(D2c) 如問題 (D2b) 的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

#### (D3) 存入實物股票所涉及的問題證券風險[註 5] - 適用於香港結算的適用於香港結算的結算參與者及託管商參與者

(D3a) 貴公司是否接受存入實物股票？

(D3b) 如問題(D3a) 的回答為「是」，貴公司可有在本審查年度期間利用「即時記存」形式存入合資格證券？

(D3c) 如問題(D3a) 的回答為「是」，貴公司可有機會在未來12個月利用「即時記存」形式存入合資格證券？

(D3d) 如問題(D3b) 或(D3c) 的回答為「是」，貴公司可有控制措施以管理以利用「即時記存」形式寄存實物股票在未獲確認有效前的賣出及轉讓之風險？

(D3e) 如問題(D3d) 的回答為「是」，請註明該等措施\*。

(D3f) 如問題(D3c)和(D3d) 的回答均為「否」，請提供補充資料解釋貴公司為何沒有措施以管理於(D3d)所述的風險\*。

---

#### (D4) 交收營運及流動性 - 適用於香港結算的直接結算參與者及全面結算參與者

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

- (D4a) 貴公司可設有(1)指定員工專門負責密切關注相關規則更新及通告及其後的跟進工作及(2)紀錄用以追蹤及確定香港結算所發出的相關規則更新及通告已分發予相關員工及已評估需否跟進，以確保有密切關注所有由香港結算發出的相關規則更新及通告？
- (D4b) 貴公司是否有程序或工具(例如:步驟清單或系統表板)設有經輸入者核對者簽核批准的主要交收步驟清單(每個步驟均清楚列出時限)，以確保所有相關人員嚴格遵照規定時間表順利執行交收程序？
- (D4c) 如問題(D4b)的回答為「是」，請確認貴公司已附上最新版本的清單或系統表板。
- (D4d) 貴公司是否設有流動資金管理程序，包括(1)去預測您的結算所清算金額(包括所有適用的結算貨幣，如人民幣、美元等外幣)，(2)對比預測金額和指定用於結算的銀行帳戶內的餘額，以及(3)就出現資金短缺建立既定的通知，上報和處理程序？
- (D4e) 貴公司是否有於另一名具相同結算參與者資格的經紀處設立戶口，作為後備交易及結算的後備安排？
- (D4f) 如問題(D4e)的回答為「是」，請註明經紀的名稱\*。
- (D4g) 貴公司會否不時選用以預先繳付現金指示 (cash prepayment) 形式進行交收以便在結算日立即使用證券？
- (D4h) 如問題(D4g)的回答為「是」，貴公司可有設立常設指示(Cash Prepayment Standing Instruction)授權中央結算系統在每個結算日自動發出預先繳付現金指示及執行相關扣款？
- (D4i) 就客戶下達的大宗賣盤，貴公司是否備有清晰程序適時向香港結算提供指定抵押證券以降低在市場波動的情況下所產生的市場差額/保證金 (Marks/Margin) 抵押品要求及計算持倉？
- (D4j) 就客戶下達的大宗買盤，貴公司是否備有清晰程序適時向香港結算提供指定現金抵押品以降低在市場波動的情況下所產生的市場差額/保證金 (Marks/Margin) 抵押品要求及計算持倉？
- (D4k) 如問題(D4a)至(D4e)或(D4h)至(D4j)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

\*如問卷的回答空間不足夠，請另附補充文檔並加以註明；有關如何呈交補充文檔，詳情請參照「指引」的B部。

[註 5]：請注意，結算參與者在過戶處確認相關股票為有效及所有權無誤之前已存入以為待交付的持倉進行交收的實物股票，如其後發現有問題，即出現問題證券風險。請參閱《中央結算系統運作程序規則》第七節（尤其是7.2.2「參與者對問題合資格證券應負的責任」及7.2.3「即時寄存」）。

**2022合規評核及現場視察之年度計劃  
合規評核問卷**

**第二(丙)部分 - 風險管理 (III)**

(此部分只適用於：

- (i) 期貨結算公司的結算參與者及全面結算參與者；及  
(ii) 聯交所期權結算所的直接結算參與者及全面結算參與者)

結算所

結算參與者

審查年度

**(E1) 持倉及風險承擔控制(衍生產品業務) - 適用於期貨結算公司/聯交所期權結算所的結算參與者**

(E1a) 貴公司是否有設下客戶風險限額(交易或持倉限額)以控制客戶層面的風險？

(E1b) 貴公司是否有使用總體風險限額(交易或持倉限額)以控制公司層面的風險？

(E1c) 如問題(E1b)的回答為「是」，請註明貴公司最近季末的總體風險限額(以百萬港元為單位)。

(E1d) 如問題(E1b)的回答為「是」，請註明貴公司最近季末的總體風險限額(以速動資金的倍數為單位)。

(E1e) 如問題(E1a)或(E1b)的回答為「是」，貴公司有否採用系統以實時監察客戶的持倉和與風險限額作對比？

(E1f) 如問題(E1a)或(E1b)的回答為「是」，在授予所提及的風險限額後，貴公司有否定期檢討該限額水平？

(E1g) 如同題(E1a)、(E1b)、(E1e)或(E1f)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

(E1h) 請註明貴公司為在市場波動的情況下的潛在按金水平提升的預估及準備措施。

(E1i) 以2022年3月15日該星期為例，貴公司有否知悉按金率通告中的按金水平修訂並適時作出相應行動，以確保客戶及貴公司為提升按金水平及時準備資金？

(E1j) 如問題(E1i)的回答為「是」，請註明貴公司在確保客戶及貴公司為提升按金水平及時準備資金方面所作的行動。

(E1k) 如同題(E1i)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

**(E2) 壓力損失及市場風險分析 - 適用於期貨結算公司/聯交所期權結算所的結算參與者**

(E2a) 貴公司的交易產品是否包括非線性產品(例如指數及股票期權)？

(E2b) 貴公司可有對客戶持倉進行壓力損失分析(預測公司於特定情況下，客戶在壓力情境中失責，其將損失之金額；以及識別哪些產品系列/類別(例如以到期月及價內/價外狀況劃分)將為壓力損失的最主要來源)?如有，請提供在審查年度內最後一次進行的壓力損失分析報告。

(E2c) 如同題(E2a)的回答為「是」，同時問題(E2b)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

如同題(E2b)的回答為「是」，請回答問題(E2d)至(E2k)。

(E2d) 進行上述壓力損失分析的人員是否交易或買賣運作以外的獨立人員？

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

- (E2e) 上述壓力損失分析是否至少每周進行一次？
- (E2f) 如問題 (E2e) 回答為「否」，請說明進行分析的頻次？
- (E2g) 在分析中最極端的壓力情境下，指數期權及股票期權的相關資產價格波動是否分別等於或高於±20%或±22%？
- (E2h) 請確認貴公司已附上壓力損失分析報告。
- (E2i) 壓力測試框架中可有訂明壓力損失承受能力？
- (E2j) 如問題 (E2i) 的回答為「是」，請說明貴公司的損失承受能力\*。
- (E2k) 如問題 (E2d)、(E2e)、(E2g)、(E2h)或(E2i) 有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

- 
- (E3) **特定風險控制(按資本額釐定的持倉限額(CBPL)及交易後操作-交易時段) - 適用於期貨結算公司/聯交所期權結算所的結算參與者**
- (E3a) 貴公司是否有持續監控持倉以確保活動不會超過CBPL？
- (E3b) 如問題(E3a)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

- 
- (E4) **特定風險控制(收市後交易時段) - 適用於期貨結算公司的結算參與者**
- (E4a) 貴公司是否有參與收市後交易時段內的交易及結算？
- 如問題(E4a)的回答為「是」，請回答問題(E4b)至(E4y)。
- (E4b) 有多少名職員會在收市後交易時段於辦公室監控交易和管理抵押品差額？
- (E4c) 請確定貴公司了解違反CBPL的行為會被視為失責事件。
- (E4d) 貴公司是否有持續監控持倉以確保交易活動不會超過CBPL？
- 如問題(E4d)的回答為「是」，請回答問題(E4e)至(E4g)。
- (E4e) 貴公司是否以系統作出持續監控，並且當內部觸發前端合計交易限額時，以限額方式制止進一步交易？
- (E4f) 如問題(E4e)回答為「否」，貴公司是否以系統作出持續監控，並於交易達到內部觸發水平時(例如，CBPL的80%)，以人工方式作進一步行動？
- (E4g) 如問題(E4f)回答為「否」，貴公司是否以人工方式作出持續監控，並於交易達到內部觸發水平時(例如，CBPL的80%)作進一步行動？
- 如問題(E4d)回答為「否」，請回答問題(E4h)至(E4i)。
- (E4h) 貴公司是否非連續監控持倉？
- (E4i) 如問題(E4h)回答為「是」，請說明監視頻繁程度。
- (E4j) 如問題(E4g)及(E4h)回答為「否」，請提供補充資料解釋以及提供貴公司的改進計劃\*。
- (E4k) 貴公司會否恆常在上午7:30-8:45之間對收市後交易時段的交易進行交易後操作(包括淨持倉和保證金抵消要求)？

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(E4l) 如問題(E4k)回答為「否」，貴公司是否在上午7:30-8:45之間只對收市後交易時段達一定交易金額的交易進行交易後操作(包括淨持倉和保證金抵消要求)？

如問題(E4l)回答為「是」，請回答問題(E4m)至(E4o)。

(E4m) • 門檻金額

(E4n) • 負責檢查持倉及決定是否需要進行對銷之負責人

(E4o) • 檢查時間

(E4p) 如問題(E4k)和(E4l)回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

(E4q) 貴公司是否有設定內部限額以限制所有客戶可以交易的合約總數？

(E4r) 如問題(E4q)的回答為「是」，請提供該限額。

(E4s) 如問題(E4q)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

(E4t) 如果於T+1期間出現重大市場波動，貴公司是否備有緩衝流動性或銀行透支額度來滿足強制性日內變動調整和保證金的催繳金額(MMC)？

如問題(E4t)回答為「是」，請回答問題(E4u)至(E4x)。

(E4u) • 緩衝流動資金金額(以百萬港元為單位)

(E4v) • 透支額度(以百萬港元為單位)

(E4w) • 可支持的合約數量及假設市場波動情況(例如:「在±13%市場波動下，預計可支持五千張期指的交易量」)

(E4x) • 請確認問題(E4r)之限額在問題(E4w)所述的風險胃納以下。

(E4y) 如問題(E4t)或(E4x)回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

(E5) **有關客戶按金對銷賬戶(COCA)的風險控制 - 適用於期貨結算公司/聯交所期權結算所的結算參與者**

(E5a) 貴公司可設有適用於期貨結算公司按金對銷的標準政策及程序(如果貴公司不是期貨結算公司的結算參與者，請選擇「不適用」)？

(E5b) 貴公司可設有適用於聯交所期權結算所按金對銷的標準政策及程序(如果貴公司不是聯交所期權結算所的結算參與者，請選擇「不適用」)？

(E5c) 如問題(E5a)或(E5b)的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

(E5d) 客戶按金對銷賬戶每日的按金對銷是否由系統自動執行？

(E5e) 如問題(E5d)的回答為「否」，請註明客戶按金對銷賬戶每日的按金對銷程序\*。

貴公司是否指定個別人士來檢視和批准客戶按金對銷賬戶內的持倉資料，以確保倉位符合期貨結算公司程序第2.2.6.3條和聯交所期權結算所運作程序第9.3.1條？

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(E5f) • 所有要求對銷的持倉均為期貨結算公司程序第2.2.6.3條/聯交所期權結算所運作程序第9.3.1條下合資格的一對持倉

(E5g) • 每對合資格的持倉均屬於同一最終受益人

(E5h) 如同題(E5f)或(E5g)的回答為「否」，管理層如何確保對銷符合期貨結算公司程序第2.2.6.3條和聯交所期權結算所運作程序第9.3.1條？請註明有關安排\*。

(E5i) 貴公司於本審查年度有否為分配持倉予期貨結算公司的按金對銷賬戶以進行按金對銷(如果貴公司不是期貨結算公司的結算參與者，請選擇「不適用」)？

(E5j) 貴公司於本審查年度有否為分配持倉予聯交所期權結算所的按金對銷賬戶以進行按金對銷(如果貴公司不是聯交所期權結算所的結算參與者，請選擇「不適用」)？

如同題(E5i)或(E5j)的回答為「是」，請提供於本審查年度期末時涉及的大約客戶數目：

(E5k) • 期貨結算公司

(E5l) • 聯交所期權結算所

請檢閱五個交易日(須為2022年3月31日以及審查年度內持倉額最大的四個交易日)，並確認已按照期貨結算公司程序第2.2.6.3條和聯交所期權結算所運作程序第9.3.1條的客戶對銷賬戶要求，正確執行了淨減。此檢閱應由執行淨額減值的人員以外的人員執行(例如內部控制、合規或內部審計)。

(E5m) 貴公司有否在檢閱中發現客戶對銷賬戶持倉分配中有任何不正確之處？

(E5n) 如同題(E5m)的回答為「是」，請詳述根本原因和糾正措施，並指定糾正措施的完成日期\*。

(E5o) 如果上述糾正措施不能立即執行，請同時提出臨時措施，以確保遵守客戶對銷賬戶規例\*。

(E5p) 請確認您已在本證明問卷中附上(E5m)中審核的文件(包括交易記錄)以作記錄，並確保該附件可使香港交易所能夠在該四個交易日就對銷操作的準確性進行採樣檢查。

---

### (E6) 交收營運及流動性 - 適用於期貨結算公司/聯交所期權結算所的結算參與者

(E6a) 貴公司可設有(1)指明員工專門負責密切注視相關規則更新及通告及其後的跟進工作及(2)紀錄用以追蹤及確定期貨結算公司/聯交所期權結算所所發出的相關規則更新及通告已分發予相關員工及已評估需否跟進，以確保有密切注視所有由期貨結算公司/聯交所期權結算所發出的相關規則更新及通告？

(E6b) 貴公司是否有程序或工具(例如:步驟清單或系統表板)設有經輸入者核對者簽核批准的主要交收步驟清單(每個步驟均清楚列出時限)，以確保所有相關人員嚴格遵照規定時間表順利執行交收程序？

(E6c) 如同題(E6b)的回答為「是」，請確認貴公司已附上最新版本的清單或系統表板。

(E6d) 貴公司是否設有流動資金管理程序，包括(1)去預測您的結算所清算金額(包括所有適用的結算貨幣，如人民幣、美元等外幣)，(2)對比預測金額和指定用於結算的銀行帳戶內的餘額，以及(3)就出現資金短缺建立既定的通知，上報和處理程序？

(E6e) 貴公司是否有於另一名具相同結算參與者資格的經紀處設立戶口，作為後備交易及結算安排？

(E6f) 如同題(E6e)的回答為「是」，請註明經紀的名稱。

(E6g) 如同題(E6a)至(E6e)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

**2022合規評核及現場視察之年度計劃  
合規評核問卷**

---

(E7) **特定風險控制(衍生產品假期交易) - 適用於期貨結算公司的結算參與者**

(E7a) 貴公司是否假期交易的結算參與者?

如問題(E7a)的回答為「是」，請回答問題(E7b)至(E7f)。

(E7b) 請確認貴公司在假期交易日有足夠擁有電子銀行服務授權的員工當值，以支援在必要情況下所需的資金調撥及結餘查詢。

(E7c) 貴公司是否備有在假期交易日前(H-1日)預撥資金的程序，並且會在H-1日11時前下達指示將備用資金存至共同抵押品管理系統 ( CCMS )，以應付假期交易日的結算資金需求?

(E7d) 貴公司是否會在H-1日預備美元(以及其他所需幣種)備用資金?

(E7e) 貴公司是否備有(這包括銀行或集團內提供的)透支額度以支持結算資金需求，並且已確認該透支額度可在假期交易日動用和可以支援以美元(以及其他所需幣種)提取資金?

(E7f) 如問題 (E7b) 至 (E7e) 有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋\*。

---

\*如問卷的回答空間不足夠，請另附補充文檔並加以註明；有關如何呈交補充文檔，詳情請參照「指引」的B部。

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

### 第三部分 - 結算規則之責任

(此部分只適用於：

- (i) 香港結算的直接結算參與者、全面結算參與者及託管商參與者；
- (ii) 期貨結算公司的結算參與者及全面結算參與者；及
- (iii) 聯交所期權結算所的直接結算參與者及全面結算參與者)

結算所

結算參與者或託管商參與者名稱

審查年度

### 香港結算

如(C1a)或(C1b)的答案為「是」，方須填寫本部分(F1)至(F4)。- 適用於香港結算的結算參與者及託管商參與者

(F1) 貴公司可有遵守以下的中央結算系統規則及中央結算系統運作程序規則？

(F1a) 持續責任 (中央結算系統規則第 1703條)

(F1b) 貴公司於審查年度內可有提供無證書合資格證券、中華通證券的託管服務？

(F1c) • 如 (F1b) 的回答為「是」，貴公司可有遵守有關無證書合資格證券及/或中華通證券的所有權、權益及權利的適用法律 (中央結算系統規則第823至824條 及 中央結算系統運作程序規則第7.14條)

(F2) 貴公司是否設有監控措施以確保遵守以下的中央結算系統規則及中央結算系統運作程序規則？

(F2a) 貴公司是否有連接及於辦公室以外或在外國司法管轄區安裝中央結算系統終端機及參與者網間連接器 (中央結算系統規則第704條 及 第3901至3904條)？

(F2b) • 如 (F2a) 的回答為「是」，貴公司是否有遵守中央結算系統規則第704條 及 第3901至3904條，設有監控措施連接及於辦公室以外或在外國司法管轄區安裝中央結算系統終端機及參與者網間連接器？

(F2c) 設有監控措施以確保持有合資格證券直至有關會議結束為止 (中央結算系統運作程序規則第8.6.4條 (ii))

(F2d) 設有監控措施以確保代客行事前取得客戶書面同意 (中央結算系統規則第904條)

(F2e) 設有監控措施就「已劃分的交易」的對手參與者的任何失責或延誤交付或付款立即以書面方式作出報告 (中央結算系統規則第 3404條)。中央結算系統規則第 3404條適用於貴公司於審查期間有或沒有任何「已劃分的交易」。(此問題只適用於託管商參與者)

(F2f) 設有監控措施豁免補購 (中央結算系統運作程序規則第10.8.3條)。中央結算系統運作程序規則第10.8.3條適用於貴公司於審查期間有或沒有任何豁免補購。(此問題只適用於託管商參與者)

(F2g) 如(F1a)、(F1c)、(F2b)、(F2c)、(F2d)、(F2e)或(F2f)有任何一題的回答為「否」，請就中央結算系統規則及中央結算系統運作程序規則提供補充資料解釋。  
\*。

(F3) 與交收代理的安排

(F3a) 貴公司在審查年度或之後可有委任交收代理以代表其連接中央結算系統及於中央結算系統進行交收及其他活動 (中央結算系統規則第3801條)？

如問題(F3a)的回答為「是」，請回答問題(F3b)至(F3d)。

(F3b) 貴公司可有遵守所有涉及交收代理的責任 (中央結算系統規則第 3802條)？

(F3c) 貴公司的交收代理是否於辦公室以外或未有在外國司法管轄區連接及安裝中央結算系統終端機及參與者網間連接器 (中央結算系統規則第704條及第3901至3904條)？

(F3d) • 如 (F3c) 的回答為「是」，貴公司的交收代理是否設有監控措施以確保遵守中央結算系統規則第704條 及 第3901至3904條，遵守有關連接及於辦公室以外或在外國司法管轄區安裝中央結算系統終端機及參與者網間連接器的中央結算系統規則及中央結算系統運作程序規則？

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(F3e) 如(F3b)或(F3d)有任何一題的回答為「否」，請就中央結算系統規則及中央結算系統運作程序規則提供補充資料解釋。\*

---

### (F4) 中華通結算

(F4a) 貴公司於審查年度或之後是否為中華通結算參與者？(如貴公司是中華通交易所參與者及/或透過中華通交易所參與者買賣之交易所參與者，但並沒有登記成為中華通結算參與者，請選擇「否」。)

如同題(F4a)的回答為「是」，請回答問題(F4b)。

(F4b) 貴公司是否遵守持股限制的規定及有關安排？(中央結算系統規則第4110(iv)條)

(F4c) 如(F4b)的回答為「否」，請就中央結算系統規則及中央結算系統運作程序規則提供補充資料解釋。\*

---

### 期貨結算公司

如(C1c)的答案為「是」，方須填寫本部分(F5)至(F7)。-適用於期貨結算公司的結算參與者

(F5) 貴公司可有遵守期貨結算所參與者的持續責任(期貨結算公司規則第214條)？

(F6) 貴公司是否設有監控措施以確保貴公司根據交易及持倉的性質於期貨結算所提供的衍生產品結算及交收系統的結算戶口記錄所有的交易及持倉？(期貨結算公司程序第1.2條)

(F6a) 如(F5)或(F6)有任何一題的回答為「否」，請就期貨結算所規則及程序提供補充資料解釋。\*

(F7) 貴公司及其客戶於審查期間可有任何莊家活動[註6]，或進行任何莊家活動安排[註7]？

如(F7)的答案為「是」，方須填寫本部分(F7a)至(F7b)。

(F7a) 貴公司或其客戶是否把沒有莊家執照情況下進行的合約之交易或持倉記錄在莊家戶口？

(F7b) 貴公司或其客戶是否在持有莊家執照情況下，但把並非進行莊家活動(即為活動為滿足莊家規定之合約，例如報價要求、提供持續報價等)的合約之交易或持倉記錄在莊家戶口？

(F7c) 如(F7a)或(F7b)的答案為「是」，請說明及提供補充資料以解釋就期貨結算所規則及程序出現的違規或缺失(期貨結算公司規則第1.2.5條)

---

### 聯交所期權結算所

如(C1d)的答案為「是」，方須填寫本部分(F8)至(F10)。-適用於聯交所期權結算所的結算參與者

(F8) 貴公司可有遵守聯交所期權結算所參與者的持續責任(聯交所期權結算所規則第401, 403條)？

(F9) 貴公司是否設有監控措施以確保貴公司遵守以下的聯交所期權結算所規則及聯交所期權結算所運作程序？

(F9a) 設有監控措施並根據交易及持倉的性質，於聯交所期權結算所提供的衍生產品結算及交收系統的結算戶口記錄所有的交易及持倉(聯交所期權結算所運作程序第1.5.1條)

(F9b) 貴公司是否於審查年度內並未維持任何個別客戶戶口？

(F9c) • 如(F9b)的回答為「是」，貴公司是否設有監控措施以確保個別客戶戶口符合其客戶期權交易的記錄(聯交所期權結算所運作程序第5.6條)

(F9d) 貴公司是否有與期權經紀交易所參與者交易及為其持倉？

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (F9e) • 如 (F9d) 的回答為「是」，貴公司是否設有監控措施於期權經紀交易所參與者的個別客戶戶口（聯交所期權結算所運作程序第1.8, 1.8.1及1.8.2條）
- (F9f) 設有監控措施就對外持倉調整要求提供有效理由（聯交所期權結算所運作程序第5.5條）
- (F9g) 設有監控措施就有關聯交所期權結算所參與者對本身或代其客戶的持倉進行的指定分配機制（聯交所期權結算所運作程序第6.2.1條）
- (F9h) 貴公司是否有共同抵押品管理系統抵押品服務？
- (F9i) • 如 (F9h) 的回答為「是」，貴公司是否設有監控措施確保在透過衍生產品結算及交收系統提出備兌要求前，貴公司的共同抵押品管理系統抵押品戶口中的證券抵押品結餘足夠用以備兌認購期權短倉（聯交所期權結算所運作程序第7.2.4條）
- (F9j) 如(F8)、(F9a)、(F9c)、(F9e)、(F9f)、(F9g)或(F9i)有任何一題的回答為「否」，請就期權結算規則及期權買賣交易所參與者結算運作程序提供補充資料解釋。\*
- (F10) 貴公司及其客戶於審查期間可有任何莊家活動[註6]，或進行任何莊家活動安排[註7]？

如(F10)的答案為「是」，方須填寫本部分(F10a)至(F10b)。

- (F10a) 貴公司或其客戶是否在沒有莊家執照的情況下，進行合約之交易或持倉並記錄在莊家戶口？
- (F10b) 貴公司或其客戶是否在持有莊家執照情況下，但把並非進行莊家活動（即為活動為滿足莊家規定之合約，例如報價要求、提供持續報價等）的合約之交易或持倉記錄在莊家戶口？
- (F10c) 如(F10a)或(F10b)的答案為「是」，請說明及提供補充資料以解釋就期貨結算所規則及程序出現的違規或缺失（期貨結算公司規則第1.2.5條）

[註6]: 莊家活動指活動為滿足莊家規定之相關合約，例如報價要求、提供持續報價等。沒有莊家執照情況下，進行合約之交易或持倉(即並非進行莊家活動)並不可以記錄於莊家戶口。

[註7]: 莊家活動安排指一名莊家與一個法人團體之間的一項安排，根據此安排，該法人團體同意在該莊家獲本交易所發給莊家執照的「市場」內進行莊家活動。

\*如問卷的回答空間不足夠，請另附補充文檔並加以註明；有關如何呈交補充文檔，詳情請參照「指引」的B部。

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

### 第四部分 - 指定風險監控 (交易系統 #1 - #3)

(此部分只適用於期交所參與者及聯交所的期權交易所參與者)

交易所/交易所參與者

交易所參與者名稱

審查年度

- 本節包含三組重複的問題，每組由六個問題組成。
- 請貴公司按每個通過OAPI發送訂單的交易系統填寫一組問題(例如，問題(G1) – (G6))。
- 您最多可以在此問卷為三個交易系統填寫答案(即，問題(G1) – (G18))，如果有多於三個交易系統，請用「第五部分 - 指定風險監控之補充範本」為其餘的交易系統填寫答案。
- 您不用就HKATS Online ( 瀏覽器開啟的前端應用程式 ) 填寫此問卷。

關於遵守有關使用HKATS的期交所規則第807A條和/或期權交易規則第 505條以及2020年1月22日發出的“強制性定期重新認證 OAPI 應用程式”通函(編號: MO/DT/010/20)的要求，請填寫以下問題：

#### 交易系統 #1

(G1) 交易安排

(G1a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 ( G1b ) 至 ( G1f ) 提供以上交易系統的使用方法

(G1b) 手動交易系統 ( 由人手輸入訂單 )

(G1c) 算法交易系統 ( 由程式產生訂單 )

(G1d) 只限交易期貨產品之交易系統

(G1e) 只限交易期權產品之交易系統

(G1f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

(G2) 在交易系統中設置的前端監控 ( 非HKATS提供的前端監控風險管理系統 )

(G2a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(G2b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 ( G2b ) 的回答為「是」，請在 ( G2c ) 至 ( G2f ) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(G2c) • 實時價格

(G2d) • 理論價格

(G2e) • 其他 (請在 ( G2f ) 中提供其價格偏差控制機制)

(G2f) 如 ( G2e ) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(G2g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？ ( 基於價值的限制控制 )

(G2h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？ ( 基於合同數量的限制控制 )

(G2i) 如 ( G2a )、( G2b )、( G2g ) 及 ( G2h ) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

**2022合規評核及現場視察之年度計劃  
合規評核問卷**

---

(G3) **交易系統中設置之交易時監控 [註8]**

(G3a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？(基於價值的限制控制)

(G3b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

---

(G4) **其他交易系統監控**

(G4a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？

(G4b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註9]

(G4c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註10]

(G4d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(G5) **算法交易系統訂單控制 (僅適用於算法交易系統)**

如 (G1c) 的回答為「是」，請回答問題 (G5a) 至 (G5c)。

(G5a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G5b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G5c) 如 (G5a) 及 (G5b) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

(G6) **測試環境**

(G6a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施 (包括前端控制，交易後控制和其他相關控制) 進行任何功能測試？

(G6b) 如 (G6a) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*

(G6c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

---

**交易系統 #2**

(G7) **交易安排**

(G7a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

請在 (G7b) 至 (G7f) 提供以上交易系統的使用方法

(G7b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

(G7c) 算法交易系統 (由程式產生訂單)

(G7d) 只限交易期貨產品之交易系統

(G7e) 只限交易期權產品之交易系統

---

**2022合規評核及現場視察之年度計劃  
合規評核問卷**

---

(G7f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

---

(G8) **在交易系統中設置的前端監控 (非HKATS提供的前端監控風險管理系統)**

(G8a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(G8b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如 (G8b) 的回答為「是」，請在 (G8c) 至 (G8f) 中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(G8c) • 實時價格

(G8d) • 理論價格

(G8e) • 其他 (請在 (G8f) 中提供其價格偏差控制機制)

(G8f) 如 (G8e) 的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(G8g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？(基於價值的限制控制)

(G8h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

(G8i) 如 (G8a)、(G8b)、(G8g) 及 (G8h) 的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

---

(G9) **交易系統中設置之交易時監控[註8]**

(G9a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？(基於價值的限制控制)

(G9b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

---

(G10) **其他交易系統監控**

(G10a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？

(G10b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註9]

(G10c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註10]

(G10d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(G11) **算法交易系統訂單控制 (僅適用於算法交易系統)**

如 (G7c) 的回答為「是」，請回答問題 (G11a) 至 (G11c)。

(G11a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G11b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G11c) 如 (G11a) 及 (G11b) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

---

(G12) **測試環境**

(G12a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施（包括前端控制，交易後控制和其他相關控制）進行任何功能測試？

(G12b) 如（G12a）的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*

(G12c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

---

### 交易系統 #3

(G13) **交易安排**

(G13a) 請貴公司提供審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI程式之名稱及版本。

#### 請在（G13b）至（G13f）提供以上交易系統的使用方法

(G13b) 手動交易系統（由人手輸入訂單）

(G13c) 算法交易系統（由程式產生訂單）

(G13d) 只限交易期貨產品之交易系統

(G13e) 只限交易期權產品之交易系統

(G13f) 包括交易期貨及期權產品之交易系統

---

(G14) **在交易系統中設置的前端監控（非HKATS提供的前端監控風險管理系統）**

(G14a) 貴公司有否設置任何前端數量限制控制？

(G14b) 貴公司有否設置任何前端價格偏差控制？

如（G14b）的回答為「是」，請在（G14c）至（G14f）中指出價格偏差控制有否根據以下條件檢查訂單價格：

(G14c) • 實時價格

(G14d) • 理論價格

(G14e) • 其他（請在（G14f）中提供其價格偏差控制機制）

(G14f) 如（G14e）的回答為「是」，請補充相關資訊。\*

(G14g) 貴公司有否設置任何前端風險限額控制？（基於價值的限制控制）

(G14h) 貴公司有否設置任何前端持倉限額控制？（基於合同數量的限制控制）

(G14i) 如（G14a）、（G14b）、（G14g）及（G14h）的回答為「否」，請補充相關資料以解釋為何貴公司交易系統中未設置任何前端交易控制。\*

---

(G15) **交易系統中設置之交易後監控 [註8]**

(G15a) 貴公司有否設置任何交易時風險限額控制？（基於價值的限制控制）

---

## 2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(G15b) 貴公司有否設置任何交易時持倉限額控制？(基於合同數量的限制控制)

---

(G16) **其他交易系統監控**

(G16a) 貴公司有否設置任何訊息節流控制？

(G16b) 貴公司有否設置任何成交節流控制？[註9]

(G16c) 貴公司有否設置交易截斷機制？[註10]

(G16d) 請提供所有其他相關的風險控制。

---

(G17) **算法交易系統訂單控制 (僅適用於算法交易系統)**

如 (G13c) 的回答為「是」，請回答問題 (G17a) 至 (G17c)。

(G17a) 當算法交易流量明顯偏離預期流量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G17b) 當交易成交量偏離正常平均每天期貨或期權產品成交量，貴公司有否設置任何自動控制措施以防止如此情況發生？

(G17c) 如 (G17a) 及 (G17b) 的回答為「否」，請提供補充信息，以說明貴公司如何防止算法程式輸出錯誤的訂單，並對市場產生不利的影響。\*

---

(G18) **測試環境**

(G18a) 在推出交易系統新版本前，貴公司有否對其控制措施 (包括前端控制，交易後控制和其他相關控制) 進行任何功能測試？

(G18b) 如 (G18a) 的回答為「否」，請解釋為何貴公司未對風險控制措施進行測試，以及貴公司如何確保新版本交易系統中的風險控制措施能夠正常運行？\*

(G18c) 請提供貴公司OAPI之最新認證測試的日期

- END -

---

\*如問卷的回答空間不足夠，請另附補充文檔並加以註明；有關如何呈交補充文檔，詳情請參照「指引」的B部。

[註8]: 交易中是指已在HKATS的中央訂單簿中的訂單。

[註9]: 成交節流是指在規定的時間內超過規定的成交量值時觸發的風險控制措施。

[註10]: 交易截斷機制是指參與者在緊急情況下中斷交易的機制。