

2022合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷 - 第二部分

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(J1)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

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 - 第二部分

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

有關問卷的查詢，請聯絡市場監察部：

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 - 第二部分

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

- (J1) **公司名稱**
- (J1a) 聯交所參與者代號
- (J1b) 股票期權交易所參與者代號
- (J1c) 期交所參與者代號
- (J1d) 香港結算參與者代號
- (J1e) 聯交所期權結算所參與者DCASS代號
- (J1f) 期貨結算所參與者DCASS代號
- (J1g) HKATS代號
- (J2) **聯絡人(關於此問卷)**
- (J2a) 姓名
- (J2b) 職位
- (J2c) 電話號碼(直線或手機號碼)
- (J2d) 電郵地址

(J3) **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。

- (J3a) 負責人員姓名:
- (J3b) 職位:
- (J3c) 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

2022合規評核及現場視察之年度計劃
合規評核問卷 - 第二部分

第五部分 - 風險管理 (IV) — VaR 平台

(此部分只適用於香港結算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

(K1) 貴公司在審查年度內是否曾為以下結算所參與者?

(K1a) • 香港結算(直接結算參與者及全面結算參與者)

如(K1a)的答案為「是」，方須填寫所第五部分餘下的問題。

(K2) 在VaR平台推出後有關應付日終差額繳款及日終按金款項責任相關資金的安排及調撥 - 適用於香港結算的結算參與者

(K2a) 貴公司會否早在發出按金要求報告/相關估計的當晚(而非翌日早上)即時安排足夠資金以滿足日終差額繳款及日終按金款項責任?

(K2b) 如問題 (K2a) 的回答為「是」，貴公司是否按晚上約8:15時發出的CCMPY02按金要求報告(而非其他按金估算)安排資金?

(K2c) 如問題 (K2b) 的回答為「否」(即資金安排是基於估計)，貴公司是否會多撥緩衝流動資金以確保(尤其在市場波動情況下)當最後於CCMPY02按金要求報告所示按金要求多出估計時貴公司仍可滿足相關款項責任?

(K2d) 如問題 (K2b) 的回答為「否」(即資金安排是基於估計)，請提供補充資料解釋資金安排是基於何種估計(結算報告/貴公司內部估算/VaR按金模擬器/其他方式)*

(K2e) 貴公司會否在翌日早上才檢視按金要求報告以及即時安排足夠資金以滿足相關款項責任?

(K2f) 如問題 (K2e) 的回答為「是」，請提供貴公司早上會檢視CCMPY02按金要求報告的時間，以及補充資料解釋檢視結算報告及調撥資金的負責部門*。

(K2g) 如問題 (K2e) 的回答為「是」，當貴公司在早上需要調撥資金到指定結算賬戶，調撥資金是否經網上銀行轉賬?

(K2h) 如問題 (K2e) 的回答為「是」，當貴公司在早上需要調撥資金到指定結算賬戶，調撥資金是否需要涉及跨行轉賬?

(K2i) 如問題 (K2g) 的回答為「否」(即不是以網上銀行轉賬進行資金調撥)，請提供補充資料解釋貴公司會採取的資金調撥形式*。

(K2j) 如問題 (K2e) 的回答為「是」，請提供補充資料解釋貴公司如何確保早上進行的資金調撥能及時於早上9:30前滿足相關款項責任*。

(K2k) 如問題 (K2a) 及 (K2e) 的回答為「否」，請提供補充資料解釋為何貴公司沒有檢視按金要求報告以及安排資金程序*

(K3) 在VaR平台推出後有關應付即日差額繳款款項責任相關資金的安排及調撥 - 適用於香港結算的結算參與者

2022合規評核及現場視察之年度計劃
合規評核問卷 - 第二部分

- (K3a) 貴公司會在每天甚麼時間檢視Posting / Collateralisation Result Report (CCMPY01) 所載的即日差額繳款款項責任金額?
- (K3b) 貴公司有否安排預設指示授權香港結算以直接記除指示(CPI)收取即日差額繳款?
- (K3c) 如問題 (K3b) 的回答為「是」, 當貴公司需要調撥資金到指定結算賬戶, 調撥資金是否經網上銀行進行?
- (K3d) 如問題 (K3b) 的回答為「否」, 當貴公司需要透過存入資金到結算所賬戶繳付即日差額繳款款項責任, 存入資金是否經網上銀行進行?
- (K3e) 如問題 (K3c) 或 (K3d) 有任何一題的回答為「否」(即不是以網上銀行轉賬進行資金調撥), 請提供補充資料解釋貴公司會採取的資金調撥形式*。
- (K3f) 如問題 (K3b) 的回答為「否」, 請提供補充資料解釋貴公司為何不安排預設指示授權香港結算以直接記除指示(CPI)收取即日差額繳款*。

(K4) 對VaR平台推出的準備 - 適用於香港結算的結算參與者

- (K4a) 貴公司有否指派員工審視香港交易所發出有關於VaR平台推出的資料[註1]以及已更新相關運作及流動資金安排的程序?
- (K4b) 貴公司有否留意VaR平台推出後結算報告的增減及更改以及已相應更新相關內部結算程序及工具(如收支步驟清單)?
- (K4c) 如同題 (K4a) 或 (K4b) 的回答為「否」, 請提供補充資料解釋*。

- 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 1]: 相關資料見VaR平台專頁(https://www.hkex.com.hk/services/platform-services/var-platform?sc_lang=en)。