

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.

通告 CIRCULAR

事項： 2024 年合規評核及現場視察之年度計劃總結

查詢： surveillance@hkex.com.hk

參照 2024 年 4 月 5 日的交易所通告（參考編號：MSM/002/2024），香港交易及結算有限公司（「香港交易所」）公布 2024 年合規評核及現場視察之年度計劃（「2024 年度計劃」）已順利完成。

按照 2024 年度計劃，香港交易所已就交易所參與者¹及結算參與者²（統稱「參與者」）有否遵守中華通規則、香港投資者識別碼制度（「HKIDR」）及風險管理（統稱「重點範疇」）的相關規則及規定，向 29 名參與者進行現場視察，並收到 683 名參與者的合規評核問卷，回應率達 100%。

整體來說，香港交易所注意到，大部分參與者已採用系統及監控措施，以確保遵守重點範疇的相關規則及規定。然而，我們亦發現一些常見的缺失及漏洞。

總結而言，合共 62 名參與者在不同範疇上出現不合規及/或缺失的情況，包括以下方面：

中華通規則及 HKIDR 相關範疇

- 違反多項北向交易 BCAN 的要求；
- 就監督投資者資格要求及確保透過中華通交易所參與者買賣之交易所參與者（「TTEP」）已註冊的監控措施不足；
- 違反多項 HKIDR 投資者識別要求，例如未能：

¹ 香港聯合交易所有限公司及香港期貨交易所有限公司之交易所參與者

² (i) 香港期貨結算有限公司之結算參與者及全面結算參與者，及(ii) 香港中央結算有限公司及香港聯合交易所期權結算有限公司之直接結算參與者及全面結算參與者

- a. 為客戶分配正確的 BCAN ；
- b. 確保券商客戶編碼與客戶識別信息的配對文件的所有資料是準確無誤且為最新 ；
- c. 在指定時間內（即 T-1 日或之前）提交現有客戶的 BCAN ；
- d. 為自動及非自動對盤交易附加正確及有效的 BCAN ；及
- e. 在指定時間內申報已成交的合併交易指令及有關非自動對盤交易（買方）的 BCAN 。

風險管理相關範疇

- 公眾假期期間的結算操作、資金估計及持倉管理，以及風險監控（包括對客戶大宗交易/非自動對盤交易及結算參與者自營交易的風險）及資金安排上的監控措施不足；
- 未能以適當參數或頻率進行衍生產品壓力測試；
- 就確保可在特殊情況下處理客戶交易的支援及監控措施不足；
- 未有實施足夠措施以防止指定結算賬戶變成不動戶口；
- 未能就新業務活動有關的額外業務及風險控制措施通知結算所；及
- 對於獲委任處理其他交易所參與者交易訂單的參與者，其缺乏有效措施辨識交易訂單是否來自被停牌的交易所參與者，及根據《交易所規則》第 541 條向交易所申請必要的豁免。

為了提高參與者對重點範疇的合規意識，香港交易所在**附錄中**列出了主要檢查結果，並闡述了相關的合規提示（「**合規提示**」）。合規提示並未列出所有的條例，有關要求亦可能隨時變更，參與者須掌握所有其適用的相關規則及規定。

參與者應參照合規提示以審視其現行做法和程序，採取適當措施加強監控，如有任何違規或缺失應立即糾正。

香港交易所將審慎處理任何違規及缺失，並不排除考慮對不合規參與者採取紀律處分行動，包括但不限於發出書面警告、罰款及採取紀律處分程序。

香港交易所將繼續透過合規提示、指引說明及常見問題，致力加強行業對相關規則及規定的理解及遵守。

如參與者對本通告有任何回應或問題，歡迎聯絡市場監察部（電子郵件：surveillance@hkex.com.hk）。

營運科
市場監察部主管
王秉厚 謹啟

本通告以英文及另以中文譯本刊發。如本通告中文本與英文本有所出入，概以英文本為準。