

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

香港交易及結算所有限公司是《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所有限公司、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結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 (7-zip 檔案將不被接納)，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、香港結算及期權結算所參與者) - MSM01M_Identity Code_YYYYMMDD.zip；
 - (b) 第二組 (期交所參與者及期貨結算公司參與者) - MSM04F_Identity Code_YYYYMMDD.zip；
 - (c) 第三組 (非交易所參與者 - 全面結算參與者) - MSM01G_Identity Code_YYYYMMDD.zip；或
 - (d) 第四組 (非交易所參與者 - 託管商參與者) - MSM01C_Identity Code_YYYYMMDD.zip

當中 (i) 檔案名中的Identity Code必須與e通訊內選擇的參與者代號相同，和 (ii) YYYY、MM和DD分別是提交/重新提交的年、月及日。(例子: MSM01M_01234_20260628.zip)

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://ecp2.hkex.com.hk/>

e通訊用戶使用指南: https://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Trading/Securities/Stamp-Duty-Reporting-and-Payment/ECP-and-Documentation/ECP-User-Guide/ECP2_frontend_userguide.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) 聯交所參與者及雙重交易所參與者 - Trading Operations (即EU_ECPTO)；
 - (b) 期交所參與者及期貨結算公司參與者 - Operations in Derivatives Market (HKFE products) (即EU_ECPDO)；
 - (c) 香港結算參與者(非交易所參與者 - 全面結算參與者) - Self-Attestation of Compliance Questionnaire (即EU_ECPSAG)；或
 - (d) 香港結算參與者(非交易所參與者 - 託管商參與者) - Self-Attestation of Compliance Questionnaire (即EU_ECPSAC)。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

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。
 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) 壓縮檔案大小不超於100MB。
 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Client Portal Support Team：

cs_cps_cc@hkex.com.hk

有關問卷的查詢，請聯絡市場監察部：

surveillance@hkex.com.hk

2026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」)的香港結算一般規則(「香港結算一般規則」)及香港結算運作程序規則(「香港結算運作程序規則」)
- 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(直綫或手機號碼)
- (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(直綫號碼)
- (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(直綫號碼)
- (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

2026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(直綫號碼)

(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(直綫號碼)

(A6d) 電話號碼(手機號碼)

(A6e) 電郵地址

(A7) **負責合規事宜職員的聯絡資料**

(A7a) 姓名

(A7b) 職位

(A7c) 電話號碼(直綫號碼)

(A7d) 電話號碼(手機號碼)

(A7e) 電郵地址

審查年度: 由2025年4月1日至2026年3月31日

(A8) **股權結構圖 - 只適用於結算所參與者及託管商參與者** (如貴公司僅為交易所參與者, 而並非結算參與者, 請選擇「不適用」)

請根據附件的要求提供最新的 (1) 股權結構圖 及 (2) 實體持股詳情資料表。

(A8a) 提交問卷時已附上按有關要求製備的股權結構圖 (註: 附件檔案名應跟據以下資料順序組成: 先以「Shareholding update」為首, 然後是參與者代號及/或DCASS代號, 以及股權結構圖的資料日期DDMMYYYYY 分別是資料日期的日、月及年 (例子:「Shareholding update 09999, B09999 and CZZZ 07Jan2026.pdf」)。

(A8b) 提交問卷時已附上按有關要求製備的資料表 (註: 附件檔案名應跟據以下資料順序組成: 先以「Shareholding update」為首, 然後是參與者代號及/或DCASS代號, 以及股權結構圖的資料日期DDMMYYYYY 分別是資料日期的日、月及年 (例子:「Shareholding update 09999, B09999 and CZZZ 07Jan2026.xls」)。

(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分別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 (如適用), 本人明白往後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結構圖。

(A8e) 自本審查年度開始以來, 貴公司的股權結構圖是否曾有變更?

(A8f) 如(A8e)答案為「是」, 變更是否 (直接或間接) 涉及貴公司股本或投票權的20%或以上的轉變?

(A8g) 請提供股權結構圖中所有 (包括貴公司) 香港境內或境外的銀行機構名稱 (即據香港法例第155章《銀行業條例》下香港的認可機構或由香港境外銀行監管機構發牌的公司) (如所有機構都不是銀行, 請填寫「不適用」。) [註 3]

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(A8h) 請提供 (1) 在股權結構圖中所有 (包括貴公司) 在香港從事放債業務的實體名稱 (即根據香港法例第163章《放債人條例》下的放債人牌照持牌人) ("香港持牌放債人") [註 4] 及 (2) 受股權結構圖中任何實體控制 [註 5] 的所有其他香港持牌放債人的實體名稱。(如所有實體都不是香港持牌放債人及沒有控制其他香港持牌放債人, 請填寫「不適用」。)

(A8i) 請提供 (直接或間接) 擁有貴公司10%或以上股權的每家本地及海外上市公司的股票代號, 並以逗號隔開每個代號, 例: "388.HK", "000000.SZ"。(如答案為「否」, 請填寫「不適用」。)

(A8j) 請提供貴公司最大 (計入所有直接或間接持份後) 持份股東的司法管轄地。

(A9) **組織架構圖 (只適用於交易所參與者及結算所參與者 - 託管商參與者除外)**

請附上最新的組織架構圖, 當中包括主要職能部門、向管理層及董事會的匯報流程 (如果貴公司只是託管商參與者, 請選擇「不適用」)

(A9a) 提交問卷時已附上按有關要求製備的資料表, 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, 最後是組織架構圖的資料日期 DDMMYYYY 分別是資料日期的日、月及年 (例子: 「Key functions and staff 09999, B09999 and CZZZ 31Mar2026.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) 已被列於組織架構圖。

(A9c) (1) 所有部門主管、負責人員及管理層 (包括核心職能主管) 及 (2) 所有董事會成員之姓名已被列於組織架構圖。

組織補充資料

(A9d) 自審查年度起, 組織架構圖曾否有變更?

(A9e) 如(A9d)答案為「是」, 請提供補充資料*。

(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」, 請提供補充資料*。

(A10) **其他交易或結算所的參與 (只適用於結算所參與者 - 託管商參與者除外)**

(如果貴公司只是託管商參與者, 請選擇「不適用」)

(A10a) 貴公司是否在香港交易所以外的交易或結算所擁有任何交易或結算參與者資格?

(A10b) 如(A10a)的回答為「是」, 請提供交易所或結算所名稱及貴公司在其交易所或結算所的相應成員類別。

(A10c) 貴公司是否會透過其他經紀商交易非港交所產品?

(A10d) 如(A10c)答案為「是」, 請提供經紀的名稱及相關非港交所產品。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(A11) 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，而致令資料不真確或具誤導成份。

(A11a) 負責人員姓名:

(A11b) 職位:

(A11c) 日期 (dd/mm/yyyy):

隱私聲明

香港交易及結算所有限公司及其聯屬公司 (統稱「香港交易所」或「我們」) 致力保護由我們託管、控制或持有的個人資料。有關如何處理閣下的個人資料，詳情請參閱我們的隱私聲明 (https://www.hkex.com.hk/Global/Exchange/Privacy-Notice?sc_lang=zh-HK)。

*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]: 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營運官的聯絡資料。

[註 3]: 認可機構是指《銀行業條例》下的銀行、有限牌照銀行或接受存款公司。

[註 4]: 放債人是指經營貸款業務(不論有否經營其他業務)的人，或宣傳、宣布或以任何方式顯示自己是經營該業務的人，但《放債人條例》所訂明的豁免人士或豁免貸款除外。請參閱 <https://www.cr.gov.hk/tc/services/money-lenders/search/licensee-search.htm> 上的放債人牌照持牌人名單。

[註 5]: 「控制」指持有30%或以上的權益。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

第一部分 - 香港投資者識別碼制度

(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

就本部分而言

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聯屬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香港聯交所證券市場交易：

(B1a) • 代理交易

(B1b) • 自營交易

以下部分只適用於就(B1a)或(B1b)回答「是」的交易所參與者。

(B2) 在本審查年度期間，貴公司是否於領航星交易平台 - 證券市場（「系統」）輸入或發起以下任何交易類型：

(B2a) 輸入自動對盤交易指令（碎股買賣盤除外）

輸入非自動對盤交易（碎股交易除外）：

(B2b) • 兩邊客交易

(B2c) • 兩邊客交易和自動對盤交易以外的交易（「非兩邊客交易」）（交易所規則第501E條或第520條）

(B2d) 輸入非由貴公司發起的合併自動對盤交易指令或非自動對盤交易指令

(B2e) 發起合併自動對盤交易指令或非自動對盤交易指令

(B3) 遵守相關法律和聯交所規則

貴公司是否有遵守以下的《交易所規則》：

(B3a) • 券商客戶編碼與客戶識別信息的配對文件的提交要求（交易所規則第538A(3)及(4)條）

(B3b) • 券商客戶編碼與客戶識別信息的配對文件內資料須準確無誤及為最新（交易所規則第538A(5)條）

(B3c) • 不能變更或重複使用已被編派的券商客戶編碼（交易所規則第538A(5)條）

(B3d) • 向聯交所申報有關券商客戶編碼的變更（交易所規則第538A(5)條）

(B3e) • 向聯交所申報有關非自動對盤交易（買方）（交易所規則第538A(6)(c)條）

(B3f) • 合併交易指令之輸入安排及申報（交易所規則第538A(6)(d)條）

(B3g) • 為買賣盤附加券商客戶編碼（交易所規則第538A(6)(f)條）

(B3h) • 向聯交所申報券商客戶編碼錯誤（交易所規則第538A(7)(a)條）

(B3i) • 客戶授權（交易所規則第538A(8)及(9)條）

(B3j) 如(B3a)至(B3i)有任何一題的回答為「否」，請就每題相關情況提供補充資料解釋*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (B4) **投資者識別**
- 貴公司是否有適當及有效之措施，確保遵守《交易所規則》第538A(10)條的規定，包括但不限於：**
- (B4a) 貴公司是否有適當安排，確保按《交易所規則》第538A(3)及(4)條規定呈交券商客戶編碼與客戶識別信息配對文件？
- (B4b) 貴公司是否有適當防範措施，確保配對文件內的數據按《交易所規則》第538A(5)條規定是準確和最新的？
- (B4c) 貴公司有否定期審查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是準確和最新的？
- (B4d) 貴公司最近於何時就配對文件進行全面審查[註6]以確保配對文件內是準確和最新的？（請提供最近貴公司進行任何全面審查的日期。如貴公司未曾進行任何全面審查，請填寫「不適用」）
- (B4e) 貴公司有否在提交配對文件後檢查券商客戶編碼與客戶識別信息的配對檔案回應報告及處理結果報告，並根據兩個報告上顯示的回應代碼及處理結果代碼作出跟進？
- (B4f) 貴公司是否有適當監控措施及程序，按《交易所規則》第538A(5)條的規定確保編配予客戶的券商客戶編碼不會變更及被重用，除非有關修訂為因應系統升級或其他例外情況而有此需要？
- (B4g) 如需變更編配予客戶的券商客戶編碼，貴公司是否有適當的安排，確保遵守《交易所規則》第538A(5)條規定的報告要求？
- (B4h) 貴公司有否在提交更改券商客戶編碼報告及更改流通量提供者報價的券商客戶編碼報告後檢查相關的回應報告及處理結果報告，並根據兩個報告上顯示的回應代碼及處理結果代碼作出跟進？（如貴公司未曾進行任何券商客戶編碼更改，請選擇「不適用」）
- (B4i) 貴公司是否有參考香港交易所公佈的刊物（例如合規通訊，資料文件，常問問題）進行全面審查[註6]，檢視券商客戶編碼與客戶識別信息配對文件潛在的缺失？（如貴公司未曾進行任何全面審查，請選擇「不適用」）
- 貴公司是否有適當方法，確保在進行以下交易類型時已按《交易所規則》的規定輸入正確及有效的中央編號或相關券商客戶編碼：（如貴公司沒有進行所涉及的交易類型，請選擇「不適用」）
- (B4j) • 自動對盤交易指令（交易所規則第538A(6)(a)條）
- (B4k) • 兩邊客交易（交易所規則第538A(6)(b)條）
- (B4l) • 非兩邊客交易（交易所規則第538A(6)(c)條）
- (B4m) 如買方的交易所參與者未能於收市前為非自動對盤交易輸入中央編號或相關券商客戶編碼，貴公司是否有適當的監控措施和程序，以確保遵守《交易所規則》第538A(6)(c)條的相關規定期限和報告要求？（如貴公司沒有進行任何非自動對盤交易，請選擇「不適用」）
- (B4n) 貴公司有否在提交非自動對盤交易（買方）交易券商客戶編碼報告後檢查相關的回應報告及處理結果報告，並根據兩個報告上顯示的回應代碼及處理結果代碼作出跟進？（如貴公司沒有進行任何非自動對盤交易，請選擇「不適用」）
- (B4o) 貴公司是否有適當安排，確保發出合併交易指令的相關受規管中介人，按《交易所規則》第538A(6)(d)條的規定就該指令附加預設券商客戶編碼（即數值“2”）？（如貴公司不進行任何合併交易指令，請選擇「不適用」）
- (B4p) 貴公司是否有適當的安排，按《交易所規則》第538A(6)(d)條的報告要求規定，為已執行的合併交易指令於成交後的T+3日收市或之前報告該指令的相關分配？（如貴公司不進行任何合併交易指令，請選擇「不適用」）
- (B4q) 貴公司有否在提交合併交易指令報告後檢查相關的回應報告及處理結果報告，並根據兩個報告上顯示的回應代碼及處理結果代碼作出跟進？（如貴公司沒有進行任何合併交易，請選擇「不適用」）
- (B4r) 貴公司是否有採取適當措施，在自動對盤交易指令或非自動對盤交易上，按《交易所規則》第538A(6)(f)條的規定附加正確及有效的券商客戶編碼或預設券商客戶編碼？
- (B4s) 如自動對盤交易指令或非自動對盤交易輸入錯誤的券商客戶編碼，貴公司是否有適當的控制措施及程序，按《交易所規則》第538A(7)(a)及(b)條的規定，向交易所報告券商客戶編碼的任何更正？
- (B4t) 貴公司有否在提交券商客戶編碼錯誤報告後檢查相關的回應報告及處理結果報告，並根據兩個報告上顯示的回應代碼及處理結果代碼作出跟進？（如貴公司沒有任何券商客戶編碼錯誤，請選擇「不適用」）

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (B4u) 如貴公司屬結構性產品流通量提供者，貴公司是否有適當的控制措施及程序，確保已按《交易所規則》第538A(7)(c)條的規定，報告就錯誤的券商客戶編碼而作出的有關修改？（如貴公司非結構性產品流通量提供者，請選擇「**不適用**」）
- (B4v) 貴公司是否有書面政策及程序，按《交易所規則》第538A條的規定於提交報告後檢查相關的回應報告及處理結果報告以確保以下的所有報告已成功提交？
- 合併交易指令報告
 - 更改券商客戶編碼報告
 - 更改流通量提供者報價的券商客戶編碼報告
 - 券商客戶編碼錯誤報告
 - 非自動對盤交易（買方）交易券商客戶編碼報告
- (B4w) 貴公司是否有適當安排，確保公司已取得《交易所規則》第538A(8)條規定的所有必要授權及書面或其他明示同意？
- (B4x) 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，確保已按《交易所規則》第538A(9)條的規定，僅能為相關客戶輸入附加預設券商客戶編碼（即數值“1”）的沽盤？（如貴公司已獲得每位個人客戶的所有必要授權和同意及其後沒有表明撤回該授權或同意，請選擇「**不適用**」）
- (B4y) 貴公司是否有適當安排，確保券商客戶編碼的使用和取覽（即使在貴公司內）嚴格地按照「有需要知情的」原則處理？
- (B4z) 如(B4a)至(B4y)有任何一題的回答為「否」或「**不適用**」，請就每題相關情況提供答案「否」或「**不適用**」以外的補充資料解釋*。

(B5) 其他

- (B5a) 貴公司是否有專責的人員，合規及/或法律部門，以確保貴公司了解及遵守投資者識別的相關法律、規則及規例？
- (B5b) 貴公司是否有定期檢視與投資者識別相關的政策、程序及資源分配？
- (B5c) 如(B5b)的答案為「是」，請說明檢視頻次。

- (B5d) 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？
- (B5e) 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？
- (B5f) 貴公司是否有為參與投資者識別的員工提供在職培訓以外，適當及充足的培訓？
- (B5g) 如(B5f)的答案為「是」，請提供培訓形式（如內部培訓、合規通訊、其他（請註明））。*

該培訓是否包括以下範疇？

- (B5h) • 開立賬戶（包括輸入客戶識別信息）
- (B5i) • 客戶編碼與客戶識別信息的配對文件資料的編制及審查
- (B5j) • 準備和提交報告表格
- (B5k) • 編派券商客戶編碼（包括編派客戶類別）
- (B5l) 參與以上(B5h)至(B5k)工作流程的員工是否有閱讀香港交易所出版有關投資者識別要求的刊物，以促進其理解及遵照投資者識別規則？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(B5m) 如(B5a)至(B5b)、(B5d)至(B5f)或(B5h)至(B5l)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6] 就配對文件的全面審查理應涵蓋所有由貴公司維持於配對文件中的所有資料，以確保文件內容準確無誤及為最新資料，不論配對文件曾否有任何增加、減少或變更。

2026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) 在本審查年度內，貴公司是否曾為以下結算所參與者？

(C1a) • 香港結算 (直接結算參與者或全面結算參與者)

(C1b) • 香港結算 (託管商參與者)

(C1c) • 期貨結算公司 (直接結算參與者或全面結算參與者)

(C1d) • 聯交所期權結算所 (直接結算參與者或全面結算參與者)

如(C1a)的答案為「是」，方須填寫所有第二(甲)部分(C2)至(C15)和第二(乙)部分(D1)至(D8)的問題。

如(C1b)的答案為「是」，方須填寫所有第二(甲)部分(C2)和第二(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(C2)至(C15)和第二(丙)部分(E1)至(E8)的問題。

如(C1d)的答案為「是」，方須填寫所有第二(甲)部分(C2)至(C15)和第二(丙)部分(E1)至(E3)及(E5)至(E8)的問題。

(C2) 機構概況及財務更新(自審查年度起至今) - 適用於結算及託管商參與者

(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) 是否已委任臨時清盤人、清盤人、接管人或其他相關人士接管全部或部份貴公司的業務或資產？

(C2d) 公司員工人數 (不包括自僱的前線員工，例如客戶主任 (Account Executive)、客戶經理 (Relationship Manager))

(C2e) 如問題(C2a)至(C2c)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料*。

問題(C2f)至(C2h)僅適用於託管商參與者或註冊機構的全面結算參與者。

(C2f) 為履行貴公司根據香港結算運作程序規則第19.2.3條、期貨結算公司規則第214D條及聯交所期權結算所規則第403H條所須提交的財務資料責任，請確認貴公司已經電郵ClearingCreditRisk@hkex.com.hk或實體副本向香港結算、期貨結算公司及聯交所期權結算所提交了最新的財務資料。(如貴公司並非託管商參與者或根據《證券及期貨條例》(香港法例第571章)下身為註冊機構 (registered institution) 的全面結算參與者 (即RI-GCP)，請選擇「不適用」)。

(C2g) 如問題(C2f)的回答為「是」，請提供提交日期。

(C2h) 如問題(C2f)的回答為「否」，請提供 (1) 載有上述財務資料的網址，或 (2) 將財務資料以附件提交至本問卷，並在本問題中註明附件名稱 (註：附件名稱由以下資料順序組成：先以「Audited Financials」為首，然後是參與者代號及/或DCASS代號，以及財務資料的截至年份(例如「Audited Financials 09999, B09999 and CZZZ 2025.pdf」))。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(C3) **業務概況 - 適用於結算參與者**

(C3a) 貴公司是否有在審查年度內或之後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) 貴公司是否設有風險委員會，定期召開會議去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？

(C4c) 貴公司是否制定了涵蓋以下營運和風險控制程序的書面政策？[註 7]

- 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) **進行交易的渠道及系統- 適用於結算參與者**

貴公司會否透過以下渠道進行客戶交易？(如貴公司僅為結算參與者，而並非交易所參與者，請選擇「否」)

- (C5a) • 手機應用程式
- (C5b) • 網站
- (C5c) • 電腦應用程式
- (C5d) • 電話或電郵 (不包括(C5e)項下經客戶主任 (Account Executive) 下達的交易)
- (C5e) • 客戶主任 (Account Executive)
- (C5f) • 程式交易介面 (例如應用程式開發介面)
- (C5g) • 交易信息或終端

請註明貴公司交易以下產品時所用的交易系統，包括品牌及公司名稱。如果系統是由貴公司自行開發，請回答「內部研發」。

(C5h) • 股票產品

(C5i) • 衍生產品

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

請註明貴公司交易以下產品時所用的中台、後台及風險管理系統，包括品牌及公司名稱。如果系統是由貴公司自行開發，請回答「內部研發」。

(C5j) • 股票產品

(C5k) • 衍生產品

(C6) **客戶概況 - 適用於結算參與者**
(如貴公司僅為結算參與者，而並非交易所參與者或不是持牌法團[註 9]，請選擇「不適用」)

(C6a) 請確認貴公司是否在審查年度內向海外客戶[註 8]提供經紀服務。

如(C6a)的回答為「是」，請註明收入排名前三的(香港以外的)司法管轄區(截至審查年度末)。請分別提供(1)來自該地的客戶數佔客戶總數的百分比(即財務申報表表格12中的C102和C103格)和(2)以港元為單位的收入貢獻：

(C6b) • 排名第一 [例：中國內地,60%,一百萬港元]

(C6c) • 排名第二 [例：美國,20%,五十萬港元]

(C6d) • 排名第三 [例：英國,5%,十萬港元]

如(C6a)的回答為「是」，請註明淨利潤排名前三的(香港以外的)司法管轄區(截至審查年度末)。請分別提供(1)來自該地的客戶數佔客戶總數的百分比(即財務申報表表格12中的C102和C103格)和(2)以港元為單位的利潤貢獻：

(C6e) • 排名第一

(C6f) • 排名第二

(C6g) • 排名第三

(C7) **場外交易活動- 適用於結算參與者**
(如貴公司並非持牌法團[註 9]，請選擇「不適用」)

(C7a) 貴公司是否從事場外衍生產品的交易？(即使場外交易是背靠背對沖交易，請選擇「是」。)

(C7b) 如(C7a)的回答為「是」，(1)該持倉是否在向證監會遞交的每月財務申報表(財務申報表)(Form10)中報告？及(2)如有浮動虧損，是否包含在計算速動資金時的認可負債中？(如(1)或(2)的回答是否定的話，請填寫「否」)

(C7c) 如(C7b)的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(C8) **港交所產品及非港交所產品交易佣金佔比 - 適用於結算參與者**
(如貴公司並非持牌法團[註 9]，請填寫「0」)

請註明由於以下產品帶來的證券交易佣金收入(即財務申報表7027格)佔所有證券交易佣金收入的百分比(截至審查年度末)。

(C8a) • 港交所產品

(C8b) • 非港交所產品

請註明由於以下產品帶來的期貨及期權交易佣金收入(即財務申報表7036格)佔所有期貨及期權交易佣金收入的百分比(截至審查年度末)。

(C8c) • 港交所產品

(C8d) • 非港交所產品

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(C9) **承銷活動收入佔比 - 適用於結算參與者**
(如貴公司並非持牌法團[註 9], 請填寫「0」)

請註明以下在香港及海外進行的承銷活動 (即財務申報表7069格) 佔所有承銷收入的百分比 (截至審查年度末)。

- (C9a) • 首次公開招股活動
- (C9b) • 債券承銷活動
- (C9c) • 次級市場證券承銷活動

(C10) **資金調撥及授權 - 適用於結算參與者**

- (C10a) 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) ?
- (C10b) 在貴公司用作結算的指定銀行戶口中, 是否有戶口於審查年度中有三個月或以上並無任何交易?
- (C10c) 如問題(C10b)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?
- (C10d) 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?
- (C10e) 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?
- (C10f) 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? (如其中一項未設置, 請選擇「否」)
- (C10g) 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帳戶交收的同一銀行內?
- (C10h) 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帳戶之間作資金調撥[註 10]? (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」。)
- (C10i) **如問題(C10a)、(C10c)至(C10h)有任何一題的回答為「否」, 請提供補充資料解釋*。**

(C11) **特定風險控制(全面結算參與者) - 適用於結算參與者**

(C11a) 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(C11a)的回答為「是」, 請回答問題(C11b)至(C11o)。

- (C11b) 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?
- (C11c) 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?
- (C11d) 貴公司是否有針對其非結算參與者客戶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?
- (C11e) 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?
- (C11f) 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?
- (C11g) **如問題(C11b)至(C11f)有任何一題的回答為「否」, 請提供補充資料解釋*。**
- (C11h) 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?

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

如問題(C11h)的回答為「否」，請回答問題(C11i)至(C11k)。

(C11i) 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，協助將相關客戶交易組合平倉？

(C11j) 是否有程序以評估、審查和監控該第三方交易參與者或貴公司的關聯公司的信譽？

(C11k) 如問題(C11i)或(C11j)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(C11l) 貴公司是否有向非集團內部或非關聯公司的實體提供結算服務 (例如基金公司或業內的其他經紀)？

(C11m) 貴公司是否打算 (或會繼續) 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)？

(C11n) 如問題(C11l)或(C11m)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」*。

(C11o) 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？

(C12) 特定風險控制 (自營交易業務) - 適用於結算參與者

(C12a) 貴公司有否從事自營交易業務？

如問題(C12a)的回答為「是」，請回答問題(C12b)至(C12h)。

(C12b) (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%？

(C12c) 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 (截至審查年度末)。

(C12d) 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？

(C12e) 貴公司有否採用止蝕機制以控制自營交易活動的風險？

(C12f) 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？

(C12g) 如貴公司自營交易的限額被充分使用，請提供在該極端情況下的潛在損失估算 (以流動資金的百分比表示)。

(C12h) 如問題(C12d)至(C12f)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(C13) 遠程登入交易及結算系統 – 適用於結算參與者

(C13a) 貴公司是否有制定遠程工作政策/規程 (包括在家工作)，以明確列出什麼情況下將觸發遠程工作/分組工作？

(C13b) 如問題(C13a)的回答為「是」，請提供觸發遠程工作的情況及指出惡劣天氣是否已包括在觸發情況內[註 11]。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (C13c) 貴公司是否能在遠程工作期間登入所需的交易及結算系統？
- (C13d) 如問題(C13c)的回答為「是」，請提供登入交易及結算系統的方式。（例如遠端桌面/虛擬桌面基礎設施 (VDI) /交易或結算系統供應商提供的界面等）。
- (C13e) 貴公司的員工在突發情況下遠程工作（包括惡劣天氣[註 11]），期間是否會有服務臺或技術支援？
- (C13f) 貴公司是否需要關鍵員工在突發情況（包括惡劣天氣[註 11]）下回到公司工作？
- (C13g) 如問題(C13f)的回答為「是」，請提供詳細資料，包括：此類員工的數目，員工在突發情況（包括惡劣天氣[註 11]）下回到公司工作的通知/安排，包括基本維生支援和保險覆蓋。
- (C13h) 貴公司能否在遠程工作期間透過電子銀行作即時轉賬至香港結算、期貨結算公司、聯交所期權結算所的指定銀行交收賬戶？
- (C13i) 貴公司是否已把香港結算、期貨結算公司、聯交所期權結算所的指定銀行交收賬戶在電子銀行登記為可轉賬之第三方賬戶？
- (C13j) 如問題(C13i)的回答為「是」，為免自動扣款失敗，請提供目前當貴公司需要資金調撥至香港結算/期貨結算公司/聯交所期權結算所的指定銀行交收賬戶的每日最高轉賬金額。
- (C13k) 如問題(C13a)、(C13c)、(C13e)、(C13h)或(C13i)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。
- (C13l) 請提供貴公司擁有電子銀行轉賬授權權限的員工數目。
- (C13m) 請提供進行單次電子銀行資金調撥所需要的授權者數目。
- (C13n) 請提供貴公司擁有銀行賬戶的所有銀行名稱。
- (C13o) 貴公司有否在多於一間銀行設立客戶資金賬戶？
- (C13p) 如問題(C13o)的回答為「是」，貴公司是否能在遠程工作期間透過電子銀行作即時匯款至香港交易所指定的銀行結算賬戶？
- (C13q) 貴公司是否擁有活躍客戶，可以在不提供足夠資金情況下進行交易（如貨銀對付 (DVP) 客戶或固有客戶）？
- (C13r) 如問題(C13q)的回答為「是」，這些客戶是否有能力透過電子銀行進行即時匯款（即並非只能透過銀行分行存入支票去存入資金）？
- (C13s) 如問題(C13r)的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(C14) 就遠程工作的演習、培訓及備用方案 – 適用於結算參與者

- (C14a) 貴公司會否進行定期演習，以確保員工能遠程工作及進行正常業務營運？
- (C14b) 貴公司有否對支援遠程工作的系統承載能力進行持續監控和審查？
- (C14c) 貴公司有否對需要遠程工作的員工提供定期培訓？
- (C14d) 貴公司是否有員工透過家用裝備和網絡進行遠程工作時遇到任何重大問題？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (C14e) 如問題(C14d)的回答為「是」，請詳細描述該情況。*
- (C14f) 貴公司是否有備用方案來解決遠程工作中突發情況 (例如，由於網絡中斷或信號緩慢導致員工無法連接到遠程工作系統) ？
- (C14g) 如問題(C14f)的回答為「是」，請詳細描述貴公司的備用方案。*
- (C14h) 如問題(C14a)至(C14c)或(C14f)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(C15) 網路安全事故 – 適用於結算參與者

- (C15a) 自審查年度起，貴公司曾否遇過任何影響貴公司結算港交所產品營運能力的網路安全重大事故 (根據貴公司技術風險框架下的內部標準來界定) ？
- (C15b) 如果問題(C15a)的回答為「是」，請提供每宗事故的描述，包括其背景 (例如攻擊類型和入侵途徑)、影響 (例如干擾的持續時間以及任何財務或營運影響)，以及採取的糾正和後續的改進措施*。

*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 7]：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 8]：本問卷中的「海外客戶」指 (1) 在香港以外地方成立的法人實體或 (2) 持有香港以外地方發出的身份證明文件的個人。

[註 9]：持牌法團指根據《證券及期貨條例》獲發牌以進行受規管活動的法團，但並不包括認可機構(即持牌銀行、有限牌照銀行及接受存款公司)。

[註 10]：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

[註 11]：目前惡劣天氣下的結算及交收安排可參考香港交易所網站：<https://www.hkex.com.hk/Services/Trading-hours-and-Severe-Weather-Arrangements/Severe-Weather-Arrangements/Trading>

2026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？

(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*。

(D1f) 貴公司是否接受客戶進行大手交易/非自動對盤交易？(如貴公司僅為香港結算參與者，而非聯交所參與者，請選擇「不適用」。)

(D1g) 貴公司在審查年度是否曾進行過大手交易/非自動對盤交易？(如貴公司僅為香港結算參與者，而非聯交所參與者，請選擇「不適用」。)

(D1h) 如果問題(D1f)或(D1g)的回答為「是」，貴公司的交易系統是否有能力將非自動對盤交易，在中央結算系統內以「已劃分的買賣」(isolated trade) 的形式處理？

(D1i) 如果問題(D1h)的回答為「否」，請提供補充資料以作解釋。如果交易系統是由第三方提供的，請列明系統供應商的名稱*。

(D1j) 如問題(D1f)或(D1g)的回答為「是」，貴公司是否允許客戶在未有提供足夠資金之前落盤？

(D1k) 如問題(D1j)的回答為「是」，請提供補充資料解釋貴公司如何確保能履行因大手交易所產生的結算和其他清算責任*。

(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)。

(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 12] - 適用於香港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？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (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(D3d)的回答為「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，流動性及中央結算系統的連接 - 適用於香港結算的結算參與者**
- (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以及其後的跟進工作，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) 如問題(D4a)的回答為「是」，請註明指定部門或指定員工的名稱。
- (D4c) 貴公司是否制定了有記錄的結算監控程序或工具 (例如：步驟清單或系統表板)，並附有輸入者和核對者簽核及清楚列明的時間流程？
- (D4d) 如問題(D4c)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 (註：附件名稱由以下資料順序組成：先以「Settlement/Financial Control Tool」為首，然後是參與者代號及/或DCASS代號，以及財務資料的截至年份 (例如「Settlement Control Tool 09999, B09999 and CZZZ 2026.pdf」)。
- (D4e) 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？
- (D4f) 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？
- (D4g) 如問題(D4f)的回答為「是」，請註明經紀的名稱*。
- (D4h) 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？
- (D4i) 如問題(D4h)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？
- (D4j) 請確認貴公司已設定適當的中央結算系統賬戶權限，以確保交收指示、投資者交收指示和進行實物股票交易時受到適當的輸入者和核對者管控。貴公司應及時審查並更新該賬戶權限。[註 13]
- (D4k) 請確認貴公司已根據公司過去交易量及財務狀況，為員工設定適當的中央結算系統賬戶交易限額，以有效降低營運風險。
- (D4l) 請提供貴公司所有中央結算系統賬戶權限的最高交易限額值，以及相關員工的名稱和職位。
- (D4m) 如問題(D4a), (D4c)至(D4f), (D4i)至(D4k)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(D5) 大型客戶訂單風險控制 - 適用於香港結算的結算參與者

- (D5a) 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 (SSC) 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？
- (D5b) 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 (SCC) 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？
- (D5c) 對於早上的大型客戶訂單，貴公司是否知悉相關按金款項或相關指定現金抵押品款項的下單截止時間為上午11:00，以避免大量的即日差額？
- (D5d) 貴公司是否允許客戶在賣出香港市場證券後 (款項將於T+2才收到) 的同一個或次一個交易日立即利用該仍未收到之款項下單買入證券？
- (D5e) 如(D5d)的回答為「是」，當貴公司向客戶提供信貸以下單購買證券時，由於尚未有客戶款項可用於給予香港結算作為指定現金抵押品之用，貴公司是否準備了足夠的資金以滿足該交易所產生的市場差額/保證金規定？
- (D5f) 如問題(D5a)至(D5c)或(D5e)，有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。
- (D5g) 貴公司是否有任何客戶活躍於買賣高槓桿產品 (即牛熊證及認股證) ？
- (D5h) 如(D5g)的回答為「是」，貴公司是否會(1)監控因持倉過度集中於單一客戶而產生的集中風險，及(2)為高槓桿產品 (尤其是隔夜持倉) 設定較保守的 [註 14] 交易限額？
- (D5i) 如(D5h)的回答為「否」，貴公司是否制定了其他程序，以緩解對高槓桿產品的過度風險承擔？
- (D5j) 如(D5i)的回答為「是」，請提供相關程序的詳細說明。
- (D5k) 如(D5i)的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(D6) 資金安排和轉移以符合收市差額及保證金規定 - 適用於香港結算的結算參與者

- (D6a) 當相關的估算或保證金要求報告發布時，貴公司是否會在報告發布當晚已準備足夠的資金以滿足差額及保證金規定 (而非在隔日的早上準備) ？
- (D6b) 如(D6a)的回答為「否」，貴公司是否會在報告發布次日早上才審閱CCMPY02保證金要求報告並為應付早上9時30分的清算金額準備足夠的資金？
- (D6c) 如(D6b)的回答為「是」，請提供貴公司在早上審閱CCMPY02保證金要求報告的時間，以及負責審閱該報告的員工/團隊以及負責進行資金轉移的員工/團隊的資料。
- (D6d) 如(D6b)的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(D7) 資金安排和轉移以符合即日差額繳款規定 - 適用於香港結算的結算參與者

- (D7a) 貴公司何時審閱CCMPY01入帳/抵押結果報告中的即日差額繳款要求？
- (D7b) 貴公司是否已設置常設指示以通過CHATS付款指示 (CPI) 來結算所有結算貨幣 (包括港元和人民幣) 的即日付款要求？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (D7c) 如(D7b)的回答為「是」，如果需要進行資金轉移到結算指定銀行帳戶以應付清算金額，貴公司是否通過網跨行轉賬進行資金轉移？
- (D7d) 如(D7b)的回答為「否」，如果需要進行結算即日支付責任，貴公司是否通過網上轉賬支付？
- (D7e) 如(D7c)或(D7d)的回答為「否」(即資金轉移並非通過網上銀行)，請描述貴公司進行轉賬的方式。*
- (D7f) 如(D7b)的回答為「否」，請解釋貴公司為何沒有設置常設指示，以授權香港結算通過CPI來收取所有結算貨幣(包括港元和人民幣)的即日付款要求*。
-
- (D8) OTP-C中買賣盤價值限制值以減低輸入錯誤風險的使用 [註 15] - 適用於香港結算的結算參與者
- (D8a) 貴公司是否有採取政策及程序以訂定及定期檢討OTP-C中買賣盤價值限制值是否適當，以預防輸入錯誤交易的風險？
(如貴公司僅為香港結算的結算參與者，而並非聯交所交易所參與者，請選擇「不適用」)
- (D8b) 如(D8a)的回答為「是」，貴公司是否有審視交易系統中的設定，以確保每筆交易均會通過OTP-C中的買賣盤價值限制檢查？
- (D8c) 如(D8a)或(D8b)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 12]：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《香港結算系統規則》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」)。

[註 13]：例如，公司應避免分配員工同時擁有輸入及授權的權限，以讓該員工能在中央結算系統內單獨地進行交收指示及投資者交收指示或提取實體股票。

[註 14]：指較其他非高槓桿產品更為嚴格的交易限額。

[註 15]：相關背景資料請參考聯所在2026年3月2日發出之通告(編號OPS/CS/003/26 https://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Circulars-and-Notices/Participant-and-Members-Circulars/SEHK/2026/OPS_CS_003_26_c.pdf)。

2026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) 貴公司有否對客戶實施交易及/或持倉限制，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？

如問題(E1b)的回答為「是」，請註明貴公司審查年度末的總體風險限額。

(E1c) • 以百萬港元為單位

(E1d) • 以流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) 如問題(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) 貴公司有否留意按金率通告中的按金水平修訂並適時作出相應行動，以確保貴公司/客戶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) 如問題(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) 貴公司有否對自有及客戶持倉進行壓力損失分析，以評估壓力情境下的潛在損失？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。

(E2b) 如問題(E2a)的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

如問題(E2a)的回答為「是」，請回答問題(E2c)至(E2k)。

(E2c) 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？

(E2d) 上述壓力損失分析是否至少每周進行一次？

(E2e) 如問題(E2d)回答為「否」，請說明進行分析的頻次。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (E2f) 在分析中最極端的壓力場景是否符合香港交易所建議的壓力場景？ [註16]
- (E2g) 請確認貴公司已附上壓力損失分析報告 (註：附件名稱由以下資料順序組成：先以「Stress Test Sample」為首，然後是參與者代號及/或DCASS代號，以及報告樣本的資料日期(例如「Stress Test Sample 09999, B09999 and CZZZ 07Jan2026.pdf」)。
- (E2h) 請提供貴公司實施壓力損失分析的方法。(例如透過第三方供應商(請提供供應商的名稱)、內部開發的系統、其他用戶自行運算如EUC程式等。)
- (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(E2c)、(E2d)、(E2f)、(E2g)、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) - 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 (按資本額釐定的持倉限額(CBPL)及交易後操作 - 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) 有多少名當值職員會在收市後交易時段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」，貴公司於該交易時段之當值人員會否作出監控，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) 貴公司是否有非持續監控持倉？
- (E4i) 如問題(E4h)回答為「是」，請說明監視頻繁程度。
- (E4j) 如問題(E4g)或(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*。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(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 (包括淨持倉操作和提出保證金抵銷要求) ?

(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銷要求) ?

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(E4l)的回答為「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(E4y)。

(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

貴公司可設有按金對銷的標準政策及程序?

(E5a) • 適用於期貨結算公司(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) • 適用於聯交所期權結算所(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*。

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

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？

- (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) 如問題(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*。

貴公司於本審查年度有否為以下結算所分配持倉的按金對銷賬戶以進行按金對銷？

- (E5i) • 期貨結算公司 (如果貴公司不是期貨結算所的結算參與者，請選擇「不適用」)
- (E5j) • 聯交所期權結算所 (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」)

如問題(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2026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) 如問題(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 (註：附件名稱由以下資料順序組成：先以「COCA Sample」為首，然後是參與者代號及/或DCASS代號，以及樣本的資料日期 (例如「COCA Sample 09999, B09999 and CZZZ 07Jan2026 Trade Record.pdf」))。

(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) 特定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) 如問題(E6a)的回答為「是」，請註明指定部門或指定員工的名稱。
- (E6c) 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？
- (E6d) 如問題(E6c)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 (註：附件名稱由以下資料順序組成：先以「Settlement/Financial Control Tool」為首，然後是參與者代號及/或DCASS代號，以及財務資料的截至年份 (例如「Settlement Control Tool 09999, B09999 and CZZZ 2026.pdf」))。
- (E6e) 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？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(E6f) 貴公司是否有於另一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？

(E6g) 如問題(E6f)的回答為「是」，請註明經紀的名稱。

(E6h) 如問題(E6a)或(E6c)至(E6f)有任何一題的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(E7) 具體控制 (持有沽出有價外期權倉位的客戶) - 適用於期貨結算公司/聯交所期權結算所的結算參與者

(E7a) 在審查年度間，貴公司是否有任何活躍於沽出價外期權的客戶（例如，某客戶倉位初始保證金中，有超過30%與價外期權的倉位有關）？

(E7b) 如(E7a)的回答為「是」，請估算涉及問題範圍的客戶數量。

(E7c) 請估算在審查年度間單個交易日內觀察到涉及問題(E7b)內的活躍客戶總初始保證金佔結算參與者總保證金的最大百分比。

(E7d) 貴公司是否有任何單獨的風險控制措施（例如分配單獨的風險限額）來監控這些客戶的風險？

(E7e) 如(E7d)的回答為「是」，請提供詳細資料解釋（請分別說明貴公司針對沽出價外股票期權和指數期權的風險控制措施）。*

(E7f) 如(E7d)的回答為「否」，請提供補充資料解釋*。

(E8) 客戶保證金的監控和收集- 適用於期貨結算公司/聯交所期權結算所的結算參與者

(E8a) 貴公司會否在任何情況下要求客戶存入高於結算所規定的最低客戶保證金水平(即1.33倍以上的保證金)的保證金？

(E8b) 如(E8a)的回答為「是」，請說明貴公司現行政策中的具體情況和相關的程序。*

(E8c) 貴行會否在某些情況下向客戶以每項交易獨立收取保證金(即不容許個別客戶的賬戶內交易進行按金對銷)？

(E8d) 如(E8c)的回答為「是」，請說明貴公司現行政策中的具體情況和相關的程序。*

(E8e) 請問貴行每天最少會下載多少次風險系數檔案 (RPI, RPF或RPP) 檔案以作為計算客戶保證金之用？

(E8f) 請列出貴行日常下載風險系數檔案 (RPI, RPF或RPP) 檔案作為計算客戶保證金的各時間點？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (E8g) 請貴行列出在下載風險系數檔案 (RPI, RPF或RPP) 檔案後貴行會以甚麼方式處理檔案(如人手/第三方系統(請具體說明)/自行開發系統)以計算客戶保證金。若果貴行並不使用RPF (RPI, RPF或RPP) 檔案計算客戶保證金，請在此概述計算客戶保證金的方法。
- (E8h) 請列出貴行日常發出客戶保證金追繳通知的時間 (除了跟隨結算所保證金報告向客戶追繳外，請亦列出其他額外時間點(如有))。
- (E8i) 在發出客戶保證金追繳方面，貴行會否在某些情況下會有特別寬免？如有，請提供詳細資料。
- (E8j) 根據貴公司現行政策，請列明客戶追繳保證金的結算期限。

*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 16]：有關香港交易所對壓力測試的預期，請參考香港交易所年度計劃簡介會投影片資料第32頁。[https://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Rules-and-Forms-and-Fees/Rules/Rule-Enforcement/2026-Programme/2026-Info-Session-\(Chi\).pdf](https://www.hkex.com.hk/-/media/HKEX-Market/Services/Rules-and-Forms-and-Fees/Rules/Rule-Enforcement/2026-Programme/2026-Info-Session-(Chi).pdf)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

第三部分 - 交易及偏離價格風險監控 (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)

*本節所述之監控措施不包括HKATS 電子交易系統風險功能。

交易所/交易所參與者

交易所參與者名稱

審查年度

本節包括：(1) 三組重複的問題 (問題(F1)至(F18))，每組包含六條問題；以及 (2) 兩條附加問題 (問題(F19)及(F20))。

問題(F1)至(F18)

- 請貴公司就每個透過 OAPI 應用程序發出買賣盤的交易系統填寫一組問題 (例如問題 (F1)至(F6))，最多適用於三個交易系統 (即問題(F1)至(F18))。如貴公司運作超過三個交易系統，請使用標題為「第四部分 - 交易及偏離價格風險監控之補充範本」的補充範本提供額外資料。
- 如貴公司僅使用 HKATS Online，且並無運作任何 OAPI 交易系統，則毋須填寫問題 (F1)至(F18)。

問題(F19)及(F20)

- 所有期交所參與者及聯交所的期權交易所參與者，均須就其OAPI應用程序及 / 或 HKATS Online 填寫問題(F19)「錯誤交易處理程序」及問題(F20)「基礎設施安全」。

就遵守《期交所規則》第819B條、《期權交易規則》第540條、2017年7月17日發出的《衍生產品市場之錯價交易申報》的通告 (編號：MO/DT/103/17 及 MO/DT/104/17) 內有關錯價交易的規定，以及《期交所規則》第522B條及 / 或《交易所規則》第612條有關內部管控程序的規定，請填寫以下問題：

交易系統 #1

(F1) 交易安排

(F1a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(F1b)至(F1c)指明以上交易系統的類型：

(F1b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

(F1c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(F2) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(F2a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(F2b) 如問題(F2a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(F2a)的回答為「是」，請在問題(F2c)至(F2f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(F2c) 實時價格

(F2d) 理論價格

(F2e) 上一個交易日的收盤價

(F2f) 其他 (請在問題(F2g)中提供其價格偏離監控機制)

(F2g) 如問題(F2f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (F2h) 如問題(F2c)至(F2f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型(如指數期貨、指數期權、股票期權等)釐定上述參考價 / 基準價格。*
- (F2i) 如問題(F2a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？
- (F2j) 如問題(F2i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的理由，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(F2i)的回答為「是」，請在問題(F2k)至(F2m)中指出所採用的提示及攔截機制。

- (F2k) 軟封鎖機制
- (F2l) 硬封鎖機制
- (F2m) 其他 (請在問題(F2n)說明)
- (F2n) 如問題(F2m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(F3) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

- (F3a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？
- (F3b) 如問題(F3a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*
- (F3c) 如問題(F3a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*
- (F3d) 如問題(F3a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？
- (F3e) 如問題(F3d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(F3d)的回答為「是」，請在問題(F3f)至(F3i)中具體說明所採取的跟進行動。

- (F3f) 取消買賣盤
- (F3g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤
- (F3h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道(例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等)通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示
- (F3i) 其他 (請在下方的問題(F3j)中具體說明)
- (F3j) 如問題(F3i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(F4) **價格偏離相關的交易後監控 [註20]**

(F4a) 貴公司有否設置任何交易後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(F4b) 如問題(F4a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易後價格偏離的風險監控的原因。*

(F5) **算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)**

如問題(F1c)的回答為「是」，請回答問題(F5a)至(F5h)。

(F5a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

(F5b) 如問題(F5a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*

(F5c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

(F5d) 如問題(F5c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*

(F5e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(F5f) 如問題(F5e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現審查的頻率。*

(F5g) 如問題(F5e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(F5h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

(F5i) 如問題(F5h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

(F6) **風險監控的審查與測試**

(F6a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(F6b) 如問題(F6a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

(F6c) 如問題(F6a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(F6d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

交易系統 #2

(F7) 交易安排

(F7a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(F7b)至(F7c)指明以上交易系統的類型：

(F7b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

(F7c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(F8) 價格偏離相關的交易前監控 [註17]

(F8a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(F8b) 如問題(F8a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(F8a)的回答為「是」，請在問題(F8c)至(F8f)指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(F8c) . 實時價格

(F8d) . 理論價格

(F8e) . 上一個交易日的收盤價

(F8f) . 其他 (請在問題(F8g)中提供其價格偏離監控機制)

(F8g) 如問題(F8f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(F8h) 如問題(F8c)至(F8f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型(如指數期貨、指數期權、股票期權等)釐定上述參考價 / 基準價格。*

(F8i) 如問題(F8a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

(F8j) 如問題(F8i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的理由，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(F8i)的回答為「是」，請在問題(F8k)至(F8m)中指出所採用的提示及攔截機制。

(F8k) 軟封鎖機制

(F8l) 硬封鎖機制

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(F8m) 其他 (請在問題(F8n)說明)

(F8n) 如問題(F8m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(F9) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

(F9a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？

(F9b) 如問題(F9a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

(F9c) 如問題(F9a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

(F9d) 如問題(F9a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？

(F9e) 如問題(F9d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(F9d)的回答為「是」，請在(F9f)至(F9i)中具體說明所採取的跟進行動。

(F9f) 取消買賣盤

(F9g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤

(F9h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示

(F9i) 其他 (請在下方的問題(F9j)中具體說明)

(F9j) 如問題(F9i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(F10) 價格偏離相關的交易所後監控 [註20]

(F10a) 貴公司有否設置任何交易所後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(F10b) 如問題(F10a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易所後價格偏離的風險監控的原因。*

(F11) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(F7c)的回答為「是」，請回答問題(F11a)至(F11h)。

(F11a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

- (F11b) 如問題(F11a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*
- (F11c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？
- (F11d) 如問題(F11c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*
- (F11e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？
- (F11f) 如問題(F11e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現的審查頻率。*
- (F11g) 如問題(F11e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*
- (F11h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？
- (F11i) 如問題(F11h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

-
- (F12) **風險監控的審查與測試**
- (F12a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？
- (F12b) 如問題(F12a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*
- (F12c) 如問題(F12a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險監控措施仍然充分且有效。*
- (F12d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

交易系統 #3

- (F13) **交易安排**
- (F13a) 請提供貴公司於審查年度末所用的交易系統及與其相連接的OAPI應用程序之名稱及版本。

請在問題(F13b)至(F13c)提供以上交易系統的類型：

- (F13b) 手動交易系統 (由人手輸入訂單)

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(F13c) 算法交易系統 (由程序產生訂單)

(F14) 價格偏離相關的交易前監控[註17]

(F14a) 貴公司有否設置任何交易前偏離價格風險監控？

(F14b) 如問題(F14a)的回答為「否」，請提供補充資料，以說明貴公司所採取的監控措施，以防止輸入偏離由期交所及聯交所訂明的價格參數[註18]的買賣盤。*

如問題(F14a)的回答為「是」，請在問題(F14c)至(F14f)中指出價格偏離相關監控有否根據以下參考價 / 基準價格對買賣盤價格進行驗證：

(F14c) • 實時價格

(F14d) • 理論價格

(F14e) • 上一個交易日的收盤價

(F14f) • 其他 (請在問題(F14g)中提供其價格偏離監控機制)

(F14g) 如問題(F14f)的回答為「是」，請註明所採用的相關參考價 / 基準價格及採用之相關產品類型。*

(F14h) 如問題(F14c)至(F14f)有任何一題的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司如何就相關產品類型 (如指數期貨、指數期權、股票期權等) 釐定上述參考價 / 基準價格。*

(F14i) 如問題(F14a)的回答為「是」，貴公司有否設任何提示及 / 或攔截機制，以在買賣盤價格偏離貴公司相對於參考價 / 基準價格所設定的預設門檻時，提示交易系統使用者及 / 或客戶重新確認該買賣盤？

(F14j) 如問題(F14i)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設有提示及 / 或攔截機制的理由，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

如問題(F14i)的回答為「是」，請在問題(F14k)至(F14m)中指出所採用的提示及攔截機制。

(F14k) 軟封鎖機制

(F14l) 硬封鎖機制

(F14m) 其他 (請在問題(F14n)說明)

(F14n) 如問題(F14m)的回答為「是」，請補充相關資料。*

(F15) 交易時偏離價格風險監控 [註19]

(F15a) 貴公司有否設置任何交易時偏離價格風險監控？

(F15b) 如問題(F15a)的回答為「否」，請提供補充資料說明未設置任何交易時偏離價格風險監控的原因，並闡述貴公司如何降低以偏離參考價 / 基準價格之預設門檻水平執行買賣盤的風險。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(F15c) 如問題(F15a)的回答為「是」，請提供補充資料說明貴公司所採用的交易時偏離價格風險監控之措施，以降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

(F15d) 如問題(F15a)的回答為「是」，當識別到有買賣盤偏離預設門檻時，貴公司是否會採取任何跟進行動？*

(F15e) 如問題(F15d)的回答為「否」，請提供補充資料，解釋貴公司為何沒有採取任何跟進行動，並說明如何降低買賣盤執行價格偏離預設門檻的風險。*

如問題(F15d)的回答為「是」，請在問題(F15f)至(F15i)中具體說明所採取的跟進行動。

(F15f) 取消買賣盤

(F15g) 將買賣盤自中央買賣盤帳目中移除，並保留本機買賣盤帳目內作為不動盤

(F15h) 就買賣盤出現價格偏離的情況，透過任何渠道 (例如應用程式彈出視窗、電話、電郵等) 通知系統使用者 / 客戶有關情況，並就可能採取的跟進行動作出提示

(F15i) 其他 (請在下方的問題(F15j)中具體說明)

(F15j) 如問題(F15i)的回答為「是」，請提供補充資料。*

(F16) 價格偏離相關的交易所後監控[註20]

(F16a) 貴公司有否設置任何交易所後價格偏離的風險監控？(即就成交價格相對於參考價 / 基準價格進行價格偏離檢查)

(F16b) 如問題(F16a)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有設置任何交易所後價格偏離的風險監控的原因。

(F17) 算法交易偏離價格監控 (僅適用於算法交易系統)

如問題(F13c)的回答為「是」，請回答問題(F17a)至(F17h)。

(F17a) 貴公司是否設有任何自動化監控措施，以防止交易活動與該算法既有的歷史或預期交易模式出現重大偏離？

(F17b) 如問題(F17a)的回答為「否」，請提供補充資料說明貴公司所使用的量化方法，以識別及管理交易活動中可能出現的異常或偏離情況。*

(F17c) 貴公司有否保留關於算法的設計、開發、測試及審批流程、相關風險監控，以及實施後表現的文件？

(F17d) 如問題(F17c)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有保留相關文件的原因。*

(F17e) 貴公司有否對算法交易系統的表現進行定期審查？

(F17f) 如問題(F17e)的回答為「是」，請提供補充資料，說明有關表現的審查頻率。*

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(F17g) 如問題(F17e)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有就算法交易系統的表現進行定期審查的原因。*

(F17h) 貴公司有否設置任何獨立的監控功能來監察算法的交易風險？

(F17i) 如問題(F17h)的回答為「否」，請提供補充資料說明沒有獨立監控功能的原因。*

(F18) 風險控制的審查與測試

(F18a) 貴公司是否定期對偏離價格風險監控進行驗證及審查？

(F18b) 如問題(F18a)的回答為「是」，請說明進行相關驗證及審查的頻率。*

(F18c) 如問題(F18a)的回答為「否」，請提供補充資料，說明貴公司如何確保相關風險控制措施仍然充分且有效。*

(F18d) 請提供貴公司OAPI應用程序之最新認證測試的日期。*

(F19) 錯價交易處理程序

(F19a) 貴公司是否有指定的負責人員處理錯價交易的申報？

(F19b) 於審查年度內，貴公司是否曾向交易所提交任何錯價交易申報？

請於問題(F19c)至(F19g)說明，貴公司是否已制定內部指引，以處理錯誤交易，並涵蓋以下要求：

(F19c) 不同交易類別的錯誤交易於以下交易執行後的指定時限內申報，包括：

- 期貨及期權（股票期權除外）：10 分鐘
- 標準組合盤：10分鐘
- 自選組合交易：30 分鐘
- 股票期權：30 分鐘

(F19d) 確保客戶能及時向貴公司指定的負責人員申報錯價交易的相關安排

(F19e) 錯價交易申報需要的資料

(F19f) 釐定參考價 / 基準價格的方法

(F19g) 釐定交易是否偏離參考價 / 基準價格的方法

(F19h) 如問題(F19c)至(F19g)中任何一題的回答為「否」，請提供補充資料說明未有制定相關內部指引的原因，並闡述貴公司如何確保員工及相關負責人員具備足夠的知識及理解，以處理偏離參考價 / 基準價格的交易。*

(F19i) 如問題(F19a)的回答為「是」，該負責人員是否知悉每宗成功的錯價交易申報所須繳付的費用？

2026合規評核及現場視察之年度計劃 合規評核問卷

(F20) **基礎設施安全**

(F20a) 貴公司有否授權任何遠端存取以透過其內部網路連接到HKATS Online/OAPI應用程序？

如(F20a)的回答為「是」，請回答問題(F20b)至(F20e)。

(F20b) 貴公司有否對遠端連線實施任何安全控制措施？

(F20c) 貴公司有否對遠端連線進行定期網絡安全檢查或審核？

(F20d) 如問題(F20b)或(F20c)的回答為「是」，請提供補充資料說明已實施的安全控制措施，及定期網絡安全檢查或審核的頻率(如適用)。*

(F20e) 如問題(F20b)或(F20c)的回答為「否」，請提供補充資料說明未實施安全控制措施及/或定期檢查的原因。*

(F20f) 貴公司有否使用第三方服務供應商的網路連接HKATS電子交易系統，以提供網上交易服務？

(F20g) 如問題(F20f)的回答為「是」，貴公司有否與該第三方服務供應商簽訂服務協議以規範其與 HKATS 電子交易系統網路連接所需的安全控制措施？

(F20h) 如問題(F20g)的回答為「是」，請提供服務協議的最新檢閱或修訂日期，並以量化數據說明第三方服務供應商如何根據該協議在保養及技術支援方面提供足夠的服務水平。*

(F20i) 如問題(F20g)的回答為「否」，請提供補充資料以解釋為何沒有與第三方服務供應商簽訂服務協議以規範必要的安全控制措施。*

- 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，詳情請參照問卷內B部的「指引」。

[註17] 「交易前」是指買賣盤尚未輸入至HKATS中央買賣盤紀錄的階段。

[註18] 有關期交所及聯交所訂明的價格參數，請參閱香港交易所網站「錯價交易處理程序」

： https://www.hkex.com.hk/Services/Trading/Derivatives/Overview/Trading-Mechanism/Error-Trades?sc_lang=zh-HK

[註19] 「交易時」是指買賣盤已被接納至HKATS中央買賣盤紀錄的階段。

[註20] 「交易後」是指買賣盤已於HKATS中央買賣盤紀錄執行後的階段。