編號 Ref. No.:	MSM/001/2019
日期 Date:	25/02/2019

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 Comp any Limited, The SEHK Options Clearing House Limited, HKFE Clearing Corporation Limited and OTC Clearing Hong Kong Limited.

通告 CIRCULAR

事項： **2018 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 2018 年 2 月 28 日的交易所通告（參考編號：MSM/003/2018），香港交易所公布 2018 年合規評核及現場視察之年度計劃（「2018 年度計劃」）已順利完成。

按照 2018 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」）有否遵守客戶按金要求、風險管理及中華通規則（統稱「重點範疇」）的相關規則及規定，向 22 名參與者進行現場視察，並收到 744 名參與者的合規評核問卷。

整體而言，香港交易所注意到，大部分參與者已採用系統及監控措施，以確保符合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。我們已向 81 名參與者發出合規建議函，就下列方面作出改善，包括：

- 缺乏足夠的監管以確保遵守《期貨交易所規則，規例及程序》（「《期交所規則》」）第 617 條對客戶的按金要求，包括對固有客戶及「僅進行即日平倉交易的交易者」的評估
- 沒有就參與者自營及客戶的持倉進行壓力測試
- 缺乏足夠的監管以履行對結算所的結算責任
- 就中華通的交易監控及境外投資者持股監控缺乏足夠的監管

[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所有限公司之直接結算參與者及全面結算參與者

香港交易及結算所有限公司
香港中環康樂廣場8號交易廣場2期8樓
Hong Kong Exchanges and Clearing Limited
8/F, Two Exchange Square, 8 Connaught Place, Central, Hong Kong

info@hkex.com.hk
(t) +852 2522 1122 (f) +852 2295 3106
hkexgroup.com | hkex.com.hk

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調查結果和展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，參與者須掌握所有相關規則。

參與者應參照「合規提示」以審視其做法和程序，採取適當措施加強監控，如有任何類似的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，並不排除對參與者採取紀律處分行動，包括但不限於罰款及發出書面警告。就紀律處分的細節，香港交易所將稍后另行發出通告。

香港交易所將繼續透過發佈合規提示、指引及常問問題，以提高業界對相關規則及規定的理解及遵行。

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）。

市場科
市場監察部
主管
張亦伶 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。