編號 Ref. No.:	MSM/004/2022
日期 Date:	08/04/2022

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： **2021 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 2021 年 2 月 26 日的交易所通告（參考編號：MSM/002/2021），香港交易及結算所有限公司（「**香港交易所**」）公布 2021 年合規評核及現場視察之年度計劃（「**2021 年度計劃**」）已順利完成。

按照 2021 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、非自動對盤交易及風險管理（統稱「**重點範疇**」）的相關規則及規定，向 32 名參與者進行現場視察，並收到 772 名參與者的合規評核問卷，回應率達 100%。

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。我們已向合共 48 名參與者發出合規建議函，就下列方面作出改善，包括：

- 違反若干 BCAN 要求及投資者資格要求；
- 缺乏足夠監控措施以確保遵守非自動對盤交易申報的要求；
- 結算操作、資金估計及持倉管理，以及風險監控及資金安排上的控制措施不足；
- 參與者就自營及客戶的持倉所進行的壓力測試沒有足夠頻率及受壓情況；
- 缺乏全面框架及未能實施適當安排以管理業務持續性及經營風險；及
- 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。

[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

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現行做法和程序，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。