|  |  |
| --- | --- |
| **特定業務概況及內部監控摘要**  《證券及期貨條例》（“該條例”）（第571章）第402條的指明表格 | **問卷**  **B** |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **持牌法團／持牌法團申請人名稱** |  | |
| 英文 | |
|  | |
| 中文 | |
| **中央編號（如適用）** |  | |
| **請在你擬進行的業務活動的方格內加上**“**✓**”**號** | | |
| 資產管理 | | |
| 證券或期貨經紀服務 | | |
| 證券保證金融資 | | |
| 電子交易或自動化交易服務 | | |
| **就本問卷作出查詢時的聯絡人** |  | |
| 中／英文姓名 | |
|  | |
| 職銜／商號名稱 | |
|  | |
| 與申請人的關係 | |
|  |  |
| 流動電話號碼 | 電郵地址 |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| **釋義**   1. 在本問卷內，“《操守準則》＂指《證券及期貨事務監察委員會持牌人或註冊人操守準則》。 2. 在本問卷內，“《合約限量及須申報的持倉量規則》＂指《證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量) 規則》。 3. 在本問卷內，“《期權交易規則》＂指《期權交易規則**─**­­聯交所》。 4. 在本問卷內，“《期交所規則》＂指《期交所規則、規例及程序》。 5. 在本問卷內，“你＂指提供資料的該法團。 6. 除另有說明或文義另有所指外，在本問卷內的字詞和詞組應參照該條例附表1第1部或《操守準則》內對該字詞或詞組的定義詮釋。   **填寫指示**   1. 本問卷旨在獲取有關你的業務概況及內部監控的資料，包括在確保遵從監管規定方面的政策及監控。本問卷亦可用作為自我評估工具，讓你能了解自己的業務概況及評估相關的風險管理措施及內部監控程序。你應盡你所知填寫本問卷，以正確地反映你本身的運作及監控。 2. 證監會明白，鑑於持牌法團的業務活動的性質和範疇、組織和法律架構、以及管理和監察措施均存在重大差異，它們可能會採取不同的政策及監控程序。因此，本問卷內的問題並不意味當中提到的情況是（亦不應被詮釋為）單一可普遍接納的內部監控或風險管理作業手法。 3. 本問卷第I至IV部所載的問題與特定業務活動（即資產管理、證券或期貨經紀服務、證券保證金融資及電子交易或自動化交易服務）有關。你只須填寫適用於你擬進行的業務活動的部分，並在向證監會遞交前簽署聲明。請也確保已夾附有關的證明文件。 4. 你可能根據〈表格A〉第9部、〈表格B〉第4部或〈表格D〉第3部被指示填寫本問卷。另一方面，如你已獲發牌，及擬進行額外的業務活動或改變業務計劃，請填寫本問卷的適用部分。例如，假如你作為持牌法團，有意提供證券保證金融資服務或電子交易或自動化交易服務，請填寫本問卷的第III或IV部（視適用情況而定）。 5. 申請／通知書如資料不足，可能增加證監會處理你的申請／通知書所需的時間，或該申請可能被退回。有關退回政策的詳情，請參閱於證監會網站（www.sfc.hk）的[發牌手冊](https://www.sfc.hk/web/TC/rules-and-standards/codes-and-guidelines/guidelines/?rule=發牌手冊)。 6. 如空位不足，請用另頁填寫，並在每頁上清楚標示相關部分的序號。 7. 本問卷所索取的資料並非詳盡無遺。證監會在處理你的申請／通知的過程中，可能會要求你提供更多資料，包括（但不限於）你的書面政策、程序指引及支持你在本問卷內的回答的文件。 8. 如在本問卷或為支持本問卷而提供的資料有任何變更，你應在變更發生後立即以書面形式通知證監會。任何資料變更均可導致處理過程有所延誤。   **警告**  **所有向證監會呈交的資料及文件必需真實、正確及完整。**  **根據該條例第383(1)條，任何人──**   |  |  | | --- | --- | |  | **作出在要項上屬虛假或具誤導性的陳述（不論該陳述屬書面或口頭或其他形式），以支持該人或其他人根據或依據本條例任何條文向證監會提出的申請；且** | |  | **知道該陳述在要項上屬虛假或具誤導性，或罔顧該陳述是否在要項上屬虛假或具誤導性，** |   **即屬犯罪。**  **根據該條例第384(1)條，除第384(2)條另有規定外，任何人──**   |  |  | | --- | --- | |  | **在看來是遵從任何有關條文施加或根據任何有關條文施加的提供資料要求時，向指明收受者提供在要項上屬虛假或具誤導性的資料；且** | |  | **知道該等資料在要項上屬虛假或具誤導性，或罔顧該等資料是否在要項上屬虛假或具誤導性，** |   **即屬犯罪。**  **根據該條例第384(3)條，除第384(4)條另有規定外，任何人──**   |  |  |  | | --- | --- | --- | |  | **並非看來是遵從任何有關條文施加或根據任何有關條文施加的提供資料要求，但卻在與指明收受者執行任何有關條文授予的職能有關連的情況下，向該收受者提供在要項上屬虛假或具誤導性的紀錄或文件；且** | | |  |  | **知道該等紀錄或文件在要項上屬虛假或具誤導性，或罔顧該等紀錄或文件是否在要項上屬虛假或具誤導性；及** | |  |  | **事前曾就該項提供接獲該收受者的書面警告，該警告表明根據本款，在有關個案情況下，提供在要項上屬虛假或具誤導性的紀錄或文件會根據本款構成罪行，** |   **即屬犯罪。**  **“指明收受者”包括證監會。** |

**填寫指引**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **詳情** | **部分** | |
| 資產管理 | I | V  聲明 |
| 證券或期貨經紀服務 | II |
| 證券保證金融資 | III |
| 電子交易或自動化交易服務 | IV |

**第I部分：資產管理**

|  |
| --- |
| **第1部：業務概況** |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  | **是** | **否** |

**資產管理活動**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.1 | 請指明你是否會在管理以下資產方面獲授予作出投資決定的全部酌情權。 | |  |  |
|  |  | |  |  |
|  | a) | 集體投資計劃（“基金＂） |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 委託帳戶 |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.2 | 請指明你是否會管理 | | | | | |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | a) | 公眾基金； | |  |  |  |
|  |  | i) | 證監會認可基金 |  |  |  |
|  |  | ii) | 在其他司法管轄區認可或核准的基金 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 私人基金； | |  |  |  |
|  |  | i) | 對沖基金 |  |  |  |
|  |  | ii) | 私募及創業資金基金 |  |  |  |
|  |  | iii) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | c) | 退休基金； | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | d) | 房地產投資計劃；及 | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | e) | 委託帳戶。 | |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.3 | 請指明你是否會就你將管理的投資組合，負責其管理方面的整體運作。 |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.4 | 請指明你將管理的基金的目標投資者的地理分布。 | | |  |  |
|  |  | | |  |  |
|  | a) | 香港 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 中國內地 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 亞洲（香港及中國內地除外） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 歐洲 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 美國 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | f) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.5 | 請指明你有意管理的基金及委託帳戶數目，以及在你有意進行的業務的首12個月內的管理資產總值。 | | | |  | | |
|  |  | | | |  | | |
|  | a) | 基金總數 | |  | | | |
|  |  |  | | |  | |  |
|  |  |  | |  | | | |
|  | b) | 委託帳戶總數 | |  | | | |
|  |  |  | | |  | |  |
|  |  |  | |  | | | |
|  | c) | 管理資產總值（千港元） | |  | | | |
|  |  |  | | |  | | |  |
|  |  |  |  |  |  |  | |
|  |  |  |  |  | **是** | **否** | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.6 | 請指明你將管理的投資組合將會投資的主要資產類別^。 | | |  |  |
|  |  | | |  |  |
|  | a) | 上市證券及交易所買賣基金 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 交易所買賣衍生工具 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 私募股本 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 債券 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 場外衍生工具 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | f) | 現金及貨幣市場工具 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | g) | 基金（交易所買賣基金除外） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | h) | 虛擬資產 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | i) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | ^ 佔相關基金或委託帳戶的管理資產超過10% | | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.7 | 請指明你將管理的投資組合的投資策略。 | | |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 只有長倉 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 長短倉持股 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 多元策略 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 環球宏觀 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 受壓證券 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | f) | 量化（例如程式演算法） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | g) | 基金中的基金 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | h) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.8 | 請指明你將管理的投資組合是否將會 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 含有槓桿成分；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 從事證券借貸、回購及逆向回購交易。 | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.9 | 請指明你是否會在管理投資組合時有任何以下安排。 | | |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 側袋（side pocket）安排 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 附函（side letter）安排 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 封閉式 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 受贖回門檻所限 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 受鎖定期所限 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | f) | 非金錢利益、現金回贈或回佣共享安排 |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.10 | 請指明你是否會使用任何以下的電子交易服務。 | | |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 互聯網交易平台 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | [直達市場安排](https://www.sfc.hk/web/TC/pdf/Gazette/G.N.%201582%20of%202017%20(Chi).pdf) |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 程式買賣 |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.11 | 請提供就你將管理的基金擬採用的服務供應商的詳細資料（如有）。 | | | | |
|  |  |  | **名稱** | **是否你的集團公司或聯屬公司？** | | |
|  |  |  | **是** | **否** | |
|  | a) | 主要經紀商 |  |  |  | |
|  | b) | 執行買賣的經紀行 |  |  |  | |
|  | c) | 保管人或受託人 |  |  |  | |
|  | d) | 基金管理人 |  |  |  | |
|  | e) | 核數師 |  |  |  | |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |
| 1.12 | 請指明你是否會就你將管理的基金處理任何認購或贖回金額。 |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.13 | 就基金或委託帳戶的資產而言，請指明以下帳戶是否會以有關基金或客戶的名義而非你的名義開立及持有。 | | |  |  | |
|  |  |  |  |  | |  | |
|  | a) | 執行買賣的經紀行的交易帳戶 |  |  | |  | |
|  |  |  |  |  | |  | |
|  | b) | 在主要經紀商開立的帳戶 |  |  | |  | |
|  |  |  |  |  | |  | |
|  | c) | 保管帳戶 |  |  | |  | |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
|  |  |  |

**交易、市場推廣及基金分銷活動**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.14 | 請指明你是否會就由以下各方管理的基金或它們提供的委託帳戶管理服務進行市場推廣或分銷。 | | |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 你 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 你的集團公司 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 其他基金公司，請註明該基金公司的名稱： |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.15 | 如你在第1.14條回答“是＂，請指明你將使用的分銷渠道。 | | | |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | a) | 經你進行直接銷售 | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 由以下各方運作的網上平台 | |  |  |  |
|  |  | i) | 你 |  |  |  |
|  |  | ii) | 你的集團公司 |  |  |  |
|  |  | iii) | 第三方 |  |  |  |
|  |  |  | |  | **是** | **否** |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | c) | 經本身是以下身分的分銷商 | |  |  |  |
|  |  | i) | 你的集團公司 |  |  |  |
|  |  | ii) | 第三方 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 其他，請註明： | |  |  |  |
|  |  |  | | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.16 | 請指明你是否會為以下各方處理交易指示。 | |  | |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |
|  | a) | 你將管理的基金或委託帳戶 |  | |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |
|  | b) | 你的集團公司或其客戶 |  | |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |
|  | c) | 你的客戶（a) 除外） |  | |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |
|  | d) | 其他，請註明： |  | |  |  |
|  |  |  | | |  |  |
|  |  | | | |  |  |
| 1.17 | 如你在第1.16b)、c)或d)條回答“是＂，請指明你將為它們（即你將管理的基金或委託帳戶以外的各方）進行交易的產品。 | | | |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | a) | 證券 | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 期貨合約 | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | c) | 外匯合約 | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | d) | 場外衍生工具 | |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**非委託投資諮詢活動**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.18 | 請指明你是否會從事以下諮詢活動。 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 向個人客戶提供個人化投資建議 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 向機構客戶提供個人化投資建議 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 提供機械理財建議服務 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 發表分析或研究報告 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.19 | 請指明你是否會介紹你的客戶予其他中介機構開立交易帳戶，以執行證券交易、期貨交易或兩者。 |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

|  |
| --- |
| **第2部：內部監控** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**資產管理活動**

投資選項及表現檢討

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.1 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保代表各基金及委託帳戶進行的交易是按照基金的組成文件或委託帳戶的客戶協議書所載的條款？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.2 | 你將每隔多久就每個你將管理的基金的表現進行檢討？ | |  | |  |  |
|  | |  | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.3 | 你將每隔多久根據指標就每個你將管理的委託帳戶的表現進行檢討？ | |  | |  |  |
|  | |  | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.4 | 誰人將負責作出投資決定？（如有，請註明職銜及姓名。） | | |  |  |  |
|  |  | |  |  |  |  |
|  | a) | 投資委員會，請註明委員會成員： |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 首席投資總監 |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 個別基金或投資組合經理 |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 其他，請註明： |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |

執行及分配買賣指示

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.5 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 交易指示是基於其所能取得的最佳條件而執行； | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 所有買賣指示都得到公平分配及不得在分配過程中偏袒個別客戶；及 | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | c) | 除非有關交易是按照公平條款進行及符合以最佳價格執行的準則，否則不應代表基金或委託帳戶與關連人士進行交易？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.6 | 誰人將負責以下事項？（如有，請註明職銜及姓名。） | | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 為你將管理的投資組合發出買賣指示 | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 為你將管理的投資組合作出交易分配的決定 | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |

風險管理

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.7 | 就基金及委託帳戶層面的風險管理而言，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |
|  | a) | 妥善及持續地識別、量度、管理及監察以下風險； | |  |  |  |  |
|  |  | i) | 市場風險 |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 流動性風險 |  |  |  |  |
|  |  | iii) | 發行人及交易對手的信貸風險 |  |  |  |  |
|  |  | iv) | 營運風險 |  |  |  |  |
|  |  |  | | |  |  |  |
|  | b) | 投資組合的風險程度與向基金投資者或委託帳戶客戶提供的基金或委託帳戶性質、規模、投資組合結構和投資策略、限制及目標相符；及 | | |  |  |  |
|  |  |  | | |  |  |  |
|  | c) | 已設立風險限額制度，以控制相關持倉或風險承擔？ | | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責制訂風險限額？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  | | |  |  |  |
|  |  |  | | |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責檢視及核准風險限額？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  | iii) | 你將每隔多久在顧及市況等因素後對風險限額的合適性進行檢視？ | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.8 | 就市場風險管理而言，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保已維持涵蓋以下事項的有效的風險管理措施，以便衡量對基金的影響及（如適用）因市況不斷轉變所造成的影響？ | | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 未能預計的不利市場波動──利用合適的蒙受風險的價值（value-at-risk）衡量法或其他計算方法，估計可能出現的潛在虧損 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 個別市場因素──衡量所承擔的風險對特定市場風險因素的敏感程度 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 壓力測試──利用多項質量變數假設，以確定當市場的情況出現不正常及大幅的波動時，對投資組合所造成的影響 | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.9 | 就基金層面的流動性風險管理而言，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 就基金的投資、抵押品、市場及業務上的交易對手，按照它們各自的流動性狀況及經基金核准的流動性風險政策，執行有關風險集中程度的規定； | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 就基金的相關投資與其贖回責任之間的流動性錯配的衡量方法進行定期監察； | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 制訂適當的處理拖欠及失責的程序，及時令負責管理流動性的職員對潛在問題提高警覺； | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | d) | 在顧及基金的投資策略、流動性狀況、相關資產及責任以及贖回政策後，監察基金的流動性風險； | | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |
|  | e) | 將流動性管理融入投資決策之中； | | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |
|  | f) | 定期評估基金資產的流動性； | | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久進行該評估？ |  | | |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行該評估？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  | |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |
|  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | g) | 定期評估基金負債的流動性狀況；及 | | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久進行該評估？ | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行該評估？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  | | |  |  |  |
|  | h) | 就不同情境（包括受壓情況）下的流動性狀況進行評估，藉此評定並監察各基金的流動性風險？ | | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久進行該評估？ |  |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行該評估？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.10 | 就信貸風險管理而言，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保維持有效的信貸評估系統，以評估基金的交易對手的信用可靠性（包括主要經紀商及保管人），以及基金投資或相關發行人（如適用）的信貸風險？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.11 | 誰人將負責基金及委託帳戶層面的風險管理職能？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.12 | 就有槓桿成分的投資組合而言，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 槓桿借貸比率的水平得到妥善監察；及 |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 槓桿借貸比率的計算基準合理而審慎？ |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.13 | 就從事證券借貸、回購及逆向回購交易的投資組合，你是否已設有管限該等交易及任何現金抵押品再投資的書面抵押品估值及管理政策和現金抵押品再投資政策？ |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否＂，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用＂，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**行政與運作**

託管基金或客戶資產

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.14 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 如要將基金或委託帳戶資產交託予保管人保管，已與該保管人簽訂正式的託管協議書； | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 將所有以保管人帳戶持有的基金或客戶資產與你的資產和（除非以綜合客戶帳戶持有）你的聯繫人士及其他客戶的資產分隔開來； | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 如你將採取自行保管基金或客戶資產安排，履行保管職能的人員是獨立於履行基金及委託帳戶管理職能的人員；及 | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | d) | 你的內部紀錄與由第三者（例如結算所、保管人、交易對手及執行買賣的經紀行）所開具的紀錄定期進行對帳？ | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久進行該對帳？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行該對帳？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.15 | 誰人將負責監督基金或客戶資產的保管職能？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

估值、側袋及附函

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | |  |  |  |  |
| 2.16 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 可對基金及委託帳戶的資產進行恰當及獨立的估值； | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 種類相近的資產都是採用一致的估值方法； | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 所有管理資產定期加以估值；及 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 最少每月向委託帳戶客戶提供恰當的估值報告，並載有《基金經理操守準則》所規定的基本資料？ | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.17 | 你將每隔多久對你的估值政策及程序進行檢討？ | |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.18 | 就非流動及難以估值的投資的側袋而言，你是否 | | | | | |  | |  | |  |
|  |  | |  | |  | |  | |  | |  |
|  | | | a) | | 具有管理相關風險的能力； | |  | |  | |  | | |
|  | | | b) | | 設有涵蓋該等投資的恰當的估值政策；及 | |  | |  | |  | | |
|  | | | c) | | 設有將投資轉入及轉出側袋的運作檢查及監控措施？ | |  | |  | |  | | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.19 | 誰人將負責監督基金及客戶投資組合的估值？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.20 | 就向基金投資者提供的附函而言，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |
|  | a) | 向基金投資者提供的附函已獲正式核准； | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責核准提供附函及附函的條款？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |
|  | b) | 向若干基金投資者提供附函一事及附函的性質已適當地向所有投資者披露；及 | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將會如何將附函存在一事告知所有投資者？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |  |
|  | c) | 附函的條款已妥為實施？ | |  |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責監察實施附函條款的情況？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

費用與支出

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.21 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 充分及準確地披露你將管理的基金及委託帳戶的收費基準及數額；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 所有的收費、費用及將價格標高的做法，在有關情況下均屬公平和合理，並且是在誠信的情況下釐定的？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.22 | 就收取非金錢利益及回佣而言，你是否已設有書面政策及程序，以確保 | | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 該非金錢利益及回佣明顯地對客戶有利； | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 交易的執行符合以最佳執行條件的原則； | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | c) | 你的客戶已書面同意收取有關非金錢利益及回佣的做法；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 你就收取有關非金錢利益及回佣的做法已作出披露？ |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否＂，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用＂，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**市場推廣及分銷**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.23 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 你所作出的任何陳述或你向基金、任何基金投資者或任何委託帳戶客戶提供的資料均屬正確及沒有誤導成分；及 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 如該管理基金是證監會認可基金，所有廣告及市場推廣資料在發出前均已獲證監會認可？ | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.24 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保當你向客戶分銷基金時， | | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 你的客戶將在訂立交易前或在訂立交易時獲告知你是否獨立及有關的釐定基準；及 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 將會向你的客戶適當披露有關你將收取的任何金錢收益及非金錢收益的資料？ | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.25 | 誰人將負責監督你的市場推廣及基金分銷活動？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  | | | |
|  | |  |  |  |  |
|  |  | |  | | | |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否＂，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用＂，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**非委託投資諮詢活動**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.26 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保當你向客戶提供建議或推薦時， | | | |  |  |  |
|  |  | |  |  |  |  |  |
|  | a) | | 你的建議將經過透徹分析和考慮過其他可行途徑，然後才作出的；及 | |  |  |  |
|  |  | |  |  |  |  |  |
|  | b) | | 經考慮你所察覺的或經適當查證後理應察覺的關於該客戶的資料後，而向該客戶作出的建議行為在所有情況下都是合理的？ | |  |  |  |
|  |  | | | |  | | |
| 2.27 | 誰人將負責監督你的非委託投資諮詢活動？（如有，請註明職銜及姓名。） | | | |  | | |
|  | |  | | |  | | |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否＂，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用＂，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

**其他事項**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.28 | 假如你有意管理證監會認可基金，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保符合相關產品守則下的規定，及你是否已接觸證監會的投資產品部？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.29 | 假如你有意擔任開放式基金型公司的基金經理，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保符合《開放式基金型公司守則》，及你是否已接觸證監會的投資產品部？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.30 | 假如你將以香港以外地區的投資者為對象，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保符合該等其他司法管轄區的適用規則及規例？ |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否＂，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用＂，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

**第II部分：證券或期貨經紀服務**

|  |
| --- |
| **第1部：業務概況** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否** |

**經紀業務活動**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.1 | 請指明你是否會提供 | | |  |  |
|  |  | | |  |  |
|  | a) | 證券經紀服務；及 | |  |  |
|  |  | i) | 作為交易所參與者 |  |  |
|  |  | ii) | 向其他執行買賣的經紀行傳達或傳遞客戶的買賣指示 |  |  |
|  |  | iii) | 作為介紹經紀，向其他執行買賣的經紀行介紹客戶，使該客戶可達成證券交易或為進行證券交易而提出要約 |  |  |
|  |  | iv) | 作為介紹經紀，從客戶接收為達成證券交易而提出的要約，並以該客戶的名義將該等要約傳達予其他執行買賣的經紀行 |  |  |
|  |  | v) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 期貨經紀服務。 | |  |  |
|  |  | i) | 作為交易所參與者 |  |  |
|  |  | ii) | 向其他執行買賣的經紀行傳達或傳遞客戶的買賣指示 |  |  |
|  |  | iii) | 作為介紹經紀，向其他執行買賣的經紀行介紹客戶，使該客戶可達成期貨合約交易或為進行期貨合約交易而提出要約 |  |  |
|  |  | iv) | 作為介紹經紀，從客戶接收為達成期貨合約交易而提出的要約，並以該客戶的名義將該等要約傳達予其他執行買賣的經紀行 |  |  |
|  |  | v) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.2 | 假如你已申請或將申請作為交易所參與者的交易權，請列出有關交易所。 | | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | a) | 香港聯合交易所有限公司（“聯交所”） | |  |  |
|  |  | 參與權種類： |  |  |  |
|  |  | 申請日期： |  |  |  |
|  |  | 核准日期： |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | b) | 香港期貨交易所有限公司（“期交所”） | |  |  |
|  |  | 參與權種類： |  |  |  |
|  |  | 申請日期： |  |  |  |
|  |  | 核准日期： |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否** |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | c) | 其他，請註明交易所： |  |  |  |
|  |  | 參與權種類： |  |  |  |
|  |  | 申請日期： |  |  |  |
|  |  | 核准日期： |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.3 | 假如你已申請或將申請成為聯交所的交易所參與者、期交所的交易所參與者或兩者，請提供一封函件，承諾你將不會以交易所參與者身分展開你的第1類受規管活動、第2類受規管活動或兩者，直至(i)你的會員及交易權申請已分別獲聯交所或期交所核准；及(ii)你已依照《證券及期貨(保險)規則》所訂明的方式投購適當的保險並將之保持有效。 |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.4 | 請指明將涵蓋的產品種類。 | | |  |  |
|  |  | | |  |  |
|  | a) | 上市股票 | |  |  |
|  |  | i) | 在香港上市 |  |  |
|  |  | ii) | 在中國內地上市，請註明交易所： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | iii) | 在海外上市，請註明交易所： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | b) | 債務證券 | |  |  |
|  |  | i) | 公司債券 |  |  |
|  |  | ii) | 主權債券，由公營機構或多邊發展銀行發行的債券 |  |  |
|  |  | iii) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | c) | 交易所買賣衍生工具 | |  |  |
|  |  | i) | 上市股票期貨或期權，請註明交易所： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 上市權證或牛熊證，請註明交易所： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | iii) | 上市指數期貨或期權，請註明交易所： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | iv) | 上市貨幣期貨或期權，請註明交易所： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | v) | 上市商品期貨或期權，請註明交易所： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | vi) | 上市利率期貨或期權，請註明交易所： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | vii) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 結構性產品，請註明： | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | e) | 其他，請註明： | |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.5 | 請指明你將與你的客戶建立業務關係的渠道。 | |  |  |
|  |  | |  |  |
|  | a) | 面對面 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 你的網站 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | c) | 流動應用程式 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | d) | 其他非面對面的方式，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.6 | 請指明你將接收客戶買賣指示的渠道。 | | |  |  |
|  |  | | |  |  |
|  | a) | 經電子交易系統 | |  |  |
|  |  | i) | 互聯網交易 |  |  |
|  |  | ii) | 直達市場 |  |  |
|  |  | iii) | 程式買賣 |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 經流動應用程式 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | c) | 經電話錄音系統 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | d) | 經流動電話 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | e) | 經電郵 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | f) | 經傳真 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | g) | 經短訊服務或其他即時通訊應用程式 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | h) | 客戶親身前來辦公室處所 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  |  |  | | **是** | **否** |
|  |  |  | |  |  |
|  | i) | 其他，請註明： | |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.7 | 假如你將向執行買賣的經紀行傳達或傳遞客戶的買賣指示或轉介客戶，請提供你將向其傳達或傳遞客戶買賣指示或轉介客戶的每家執行買賣的經紀行的詳細資料。 |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | **名稱** | **營運所在國家** | **是否任何交易所的會員？** | | **是否你的集團公司或聯屬公司？** | |  |  |
|  | **是** | **否** | **是** | **否** |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.8 | 請指明你將向執行買賣的經紀行發出買賣指示的渠道。 | | |  |  |
|  |  | | |  |  |
|  | a) | 經電子交易系統 | |  |  |
|  |  | i) | 互聯網交易 |  |  |
|  |  | ii) | 直達市場 |  |  |
|  |  | iii) | 程式買賣 |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | b) | 經電話錄音系統 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | c) | 經電郵 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | d) | 經傳真 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | e) | 經短訊服務或其他即時通訊應用程式 | |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | f) | 其他，請註明： | |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.9 | 請指明你是否會向另類交易平台傳遞客戶的買賣指示。  如是的話，請註明該另類交易平台及其營運者的名稱。 | |  |  |
|  | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.10 | 假如你將以介紹經紀的身分行事，請指明執行買賣的經紀行、客戶與你之間的合約關係。 | |  |  |
|  | a) | 你與客戶，及你與執行買賣的經紀行之間的雙邊協議 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 執行買賣的經紀行、客戶與你之間的三方協議 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |  |
|  | c) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.11 | 請指明你將如何結算交易。 | |  |  |
|  | a) | 作為結算所的結算成員或中央對手方 |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | b) | 經本身是結算所的結算成員或中央對手方的集團公司，請註明： | | | | | | |  |  |
|  |  |  | | | | | | |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 經本身是結算所的結算成員或中央對手方或結算代理人的第三方中介機構，請註明： | | | | | | |  |  |
|  |  |  | | | | | | |  |  |
|  |  |  | | | | | | |  |  |
|  | d) | 其他，請註明： | | | | | | |  |  |
|  |  |  | | | | | | |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.12 | 假如你進行期貨經紀業務活動，請指明你將接納的抵押品的形式。 | |  |  |
|  | a) | 現金 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 根據期交所發表的《期交所規則》所界定的核准債務證券 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | c) | 如《期交所規則》所界定的核准證券 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | d) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**投資諮詢活動**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.13 | 請指明你是否會從事以下諮詢活動。 | | |  |  |
|  | a) | 證券諮詢服務 | |  |  |
|  |  | i) | 向個人客戶提供個人化投資建議 |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 向機構客戶提供個人化投資建議 |  |  |
|  |  | iii) | 提供機械理財建議服務 |  |  |
|  |  | iv) | 發表分析或研究報告 |  |  |
|  |  | v) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |
|  | b) | 期貨諮詢服務 | |  |  |
|  |  | i) | 向個人客戶提供個人化投資建議 |  |  |
|  |  | ii) | 向機構客戶提供個人化投資建議 |  |  |
|  |  | iii) | 提供機械理財建議服務 |  |  |
|  |  | iv) | 發表分析或研究報告 |  |  |
|  |  | v) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.14 | 請指明你擬進行的投資諮詢活動是否會附屬於以下你所進行的業務。 | |  |  |
|  | a) | 證券經紀服務 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 期貨經紀服務 |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**委託帳戶管理活動**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.15 | 請指明在你管理委託帳戶時，你是否將 | |  |  |
|  | a) | 具有全部酌情權；或 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 沒有全部酌情權。 |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.16 | 請指明你擬進行的委託帳戶管理活動是否會附屬於以下你所進行的業務。 | |  |  |
|  | a) | 證券經紀服務 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 期貨經紀服務 |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.17 | 請指明你有意管理的委託帳戶數目，以及在你有意進行的業務的首12個月內的管理資產總值。 | |  |  |
|  | a) | 委託帳戶總數 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 管理資產總值（千港元） |  |  |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | |  | | | | | | | | | **是** | **否** | |
|  | |  | | | | | | | | |  |  | |
| 1.18 | | 請指明你將管理的委託帳戶將會投資的主要資產類別^。 | | | | | | | | |  |  | |
|  | | a) | | 上市證券及交易所買賣基金 | | | | | | |  |  | |
|  | |  | |  | | | | | | |  |  | |
|  | | b) | | 交易所買賣衍生工具 | | | | | | |  |  | |
|  |  | |  | |  |  |  |  |  |  |  | |  |
|  | | c) | | 私募股本 | | | | | | |  | |  |
|  | |  | |  | | | | | | |  | |  |
|  | | d) | | 債券 | | | | | | |  | |  |
|  | |  | |  | | | | | | |  | |  |
|  | | e) | | 場外衍生工具 | | | | | | |  | |  |
|  | |  | |  | | | | | | |  | |  |
|  | | f) | | 現金及貨幣市場工具 | | | | | | |  | |  |
|  | |  | |  | | | | | | |  | |  |
|  | | g) | | 基金（交易所買賣基金除外） | | | | | | |  | |  |
|  | |  | |  | | | | | | |  | |  |
|  | | h) | | 虛擬資產 | | | | | | |  | |  |
|  | |  | |  | | | | | | |  | |  |
|  | | i) | | 其他，請註明： | | | | | | |  | |  |
|  | |  | |  | | | | | | |  |  | |
|  | |  | |  | | | | | | |  |  | |
|  | | ^ 佔委託帳戶的管理資產超過10% | | | | | | | | |  |  | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.19 | 請指明你將管理的委託帳戶的投資策略。 | |  |  |
|  | a) | 只有長倉 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 長短倉持股 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | c) | 多元策略 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | d) | 環球宏觀 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | e) | 受壓證券 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | f) | 量化（例如程式演算法） |  |  |
|  |  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |  |
|  | g) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  | |  |  |
| 1.20 | 請指明你將管理的委託帳戶是否將會 | |  |  |
|  | a) | 含有槓桿成分；及 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 從事證券借貸、回購及逆向回購交易。 |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.21 | 請指明你作為資產管理公司，是否會有非金錢利益、現金回贈或回佣共享安排。 |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.22 | 請指明就你將管理的委託帳戶而言，你是否其執行買賣的經紀行及保管人。  如否，請指明其名稱。 | |  |  |
|  | a) | 執行買賣的經紀行： |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 保管人： |  |  |
|  |  |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

|  |
| --- |
| **第2部：內部監控** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**經紀業務活動**

收取買賣指示

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.1 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 以代理人身份接收及來自你內部的買賣指示（例如自營帳戶及職員帳戶）在收發後即時記錄及在有關紀錄上蓋上時間印章； |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 你的職員被禁止在交易場地、盤房、收取買賣指示的通常營業地點或通常經營業務的地點透過流動電話收取客戶買賣指示； |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 若在交易場地、盤房、收取買賣指示的通常營業地點或通常經營業務的地點以外的地方接受買賣指示的話，你的職員須立即致電你的電話錄音系統，記錄其收到買賣指示的時間及有關指示的詳情； |  |  |  |
|  | d) | 如有疑問，核實買賣指示是否有效及有關客戶是否有權發出有關的買賣指示； |  |  |  |
|  | e) | 買賣指示（經電話接收的指示除外）完整地記錄下來，並得以妥善保存至少為期兩年； |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | f) | 凡透過電話收取的買賣指示均記錄在電話錄音系統，而有關的電話錄音會保存作為你的紀錄的一部分，為期至少六個月；及 |  |  |  |
|  | g) | 在處理客戶的指示時，作出合理的盡職審查？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.2 | | 假如你將使用即時通訊應用程式收取客戶買賣指示，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | | a) | 妥善保存及集中管理與客戶買賣指示有關的訊息以及用來儲存和處理買賣指示訊息的即時通訊帳戶和裝置； |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |  |
|  | | b) | 制定合適的安排及準備足夠的容量，以防止被不適當地修改或刪除的形式，將買賣指示訊息儲存及備份； |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |  |
|  | | c) | 妥善地認證及核實發送買賣指示訊息的客戶的身分； |  |  |  |
|  | d) | | 實施充分而合適的保安措施，以防止系統被他人入侵或安全性遭到攻擊；及 |  |  |  |
|  | e) | | 就使用即時通訊應用程式，為職員提供合適和充足的培訓？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.3 | 假如你將向另類交易平台轉發客戶買賣指示以執行有關指示，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 該等買賣指示只可以由“合資格投資者”（定義見《操守準則》第19.2段 ）所發出或源自他們；及 |  |  |  |
|  | b) | 在首次代你的客戶向另類交易平台轉發任何買賣指示前，你的客戶已知悉另類交易平台營運者編製的另類交易平台指引？ |  |  |  |

交易前監控

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.4 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 在設定以下限額時已考慮不同因素（例如將會買賣的產品種類、客戶的財政狀況、投資目標、投資經驗及交易頻率等）； | |  |  |  |
|  |  | i) | 買賣限額（包括即日交易上限（如適用）） |  |  |  |
|  |  | ii) | 信貸限額 |  |  |  |
|  |  | iii) | 持倉限額 |  |  |  |
|  |  | iv) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | | **是** | **否\*** | **不適用#** |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 授出以上限額須取得核准； | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久檢視該限額？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責核准該限額？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | c) | 遵守你所維持的客戶持倉限額的情況得到監察； | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久監察客戶的持倉限額？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行該監察？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | d) | 將適用的衍生工具的持倉限額及申報限額通知你的客戶；及 | |  |  |  |
|  | e) | 須經高級管理層核准超出買賣、信貸或持倉限額？ | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責核准超出買賣、信貸或持倉限額？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.5 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保在執行客戶的買賣指示前，指定的職員或系統會在考慮以下事項後進行交易前查核？ | | | | |  | |  |  |
|  | a) | | | | 帳戶狀況（例如活躍、已結束或被列入內部偵查名單等） |  | |  |  |
|  | b) | | | | 帳戶內是否有充足而可供運用的證券，或是否已訂立所需的證券借貸安排（如屬沽出指示） |  | |  |  |
|  | c) | | | | 客戶帳戶中存有足夠的初始保證金（就根據《期交所規則》第617(b)條並非分類為固有客戶的客戶（“固有客戶”）） |  | |  |  |
|  | d) | | | | 客戶的買賣限額（包括即日交易上限（如適用）） |  | |  |  |
|  | e) | | | | 客戶的信貸限額 |  | |  |  |
|  | f) | | | | 客戶的持倉限額 |  | |  |  |
|  | g) | | | | 客戶的買賣指示數值限額 |  | |  |  |
|  | h) | | | | 任何未清償的追繳保證金 |  | |  |  |
|  | | i) | | | 不尋常或有問題的交易（例如交易模式的改變及大手買賣成交量低的股票） |  | |  |  |
|  | | j) | | | 偏離市場的價格 |  | |  |  |
|  | | k) | | | 落盤人的權力 |  | |  |  |
|  | |  | | |  | **是** | | **否\*** | **不適用#** |
|  | |  | | |  |  | |  |  |
|  | | l) | | | 該帳戶授權使用的服務或買賣的產品 |  | |  |  |
|  | | m) | | | 其他，請註明： |  | |  |  |
|  | |  | | |  |  | |  |  |
|  | | |  | | | |  |  |  |
| 2.6 | | | 誰人將負責監察由指定的職員或系統所進行的交易前查核？（如有，請註明職銜及姓名。） | | | |  |  |  |
|  | | | |  | | |  |  |  |

買賣指示的執行

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.7 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 你的以最佳條件執行買賣指示的政策涵蓋各類資產及類別； |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 在僱用聯屬公司、關連方或第三方執行買賣指示前將進行盡職審查，及將持續監察執行結果； |  |  |  |
|  | c) | 在執行客戶的買賣指示時，採取足夠的措施以取得其所能取得的最佳條件； |  |  |  |
|  | d) | 載列釐訂執行交易或部分交易的可接受價格的方法； |  |  |  |
|  | e) | 在合理的時間內（通常會立刻進行）將買賣指示傳送至交易員、執行買賣的經紀行或自動交易系統終端機的操作員手中，否則須制訂客戶買賣指示無須即時交到適用市場以執行有關指示的許可情況； |  |  |  |
|  | f) | 於執行買賣指示後立刻與客戶確認已執行的交易；及 |  |  |  |
|  | g) | 為買賣指示由獲得執行至進行交收的整個過程，保存明晰而全面的審計線索（包括傳送時間及買賣指示的來源）？ |  |  |  |

交易後監控

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.8 | 你是否已設有書面政策及監控程序，確保涵蓋以下範疇的交易後檢視得以進行？ | |  |  |  |
|  | a) | 交易的執行質素（包括執行結果）及異常情況 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 買賣指示紀錄 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 公平地進行分配 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 違反你的交易政策及監控程序的情況 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 不合常規的情況、誤差、潛在的不當行為及不尋常或有問題的交易 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | f) | 錯誤、欺詐及其他未經授權及不當的活動 |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | | **是** | **否\*** | **不適用#** |
|  |  | |  |  |  |
| 2.9 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 已執行的交易是盡快地以公平公正的方式分配； |  |  |  |
|  | b) | 按照客戶買賣指示及接獲買賣指示的先後次序，分配已執行的交易； |  |  |  |
|  | c) | 如不同客戶的買賣指示合併處理，已執行的交易是按照比例分配予客戶；及 |  |  |  |
|  | d) | 已執行的交易不得重新分配予不同的客戶？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.10 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 及時擬備用以識別出錯誤、錯配及不尋常交易、及不符合最佳執行條件原則的交易的特殊交易報告，以進行檢視及採取跟進行動； | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責檢視該特殊交易報告？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責確保已採取適當的跟進行動？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 取消或修改交易須經高級管理層核准；及 | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責核准取消或修改交易？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | c) | 交易錯誤會被歸入“誤差”或“暫記”帳戶內，以便及早糾正錯誤或安排平倉？ | |  |  |  |

監察及匯報合約限額及持倉限額

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.11 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 除非期交所或聯交所根據《合約限量及須申報的持倉量規則》第4(2)條或證監會根據該規則第4(4)條另行作出授權，否則你或你的每名客戶所持有或控制期貨合約或股票期權合約的數目不得超逾該規則所指明的訂明上限；及 | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責監察你或你的每名客戶持有或控制的期貨合約或股票期權合約的數目？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | b) | 如你或你的任何客戶持有或控制的期貨合約或股票期權合約持倉量超逾《合約限量及須申報的持倉量規則》分別指明的須申報水平，便會在訂明時間內將相關報告或通知送交期交所或聯交所存檔或向他們遞交？ | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責監察你或你的每名客戶持有或控制的期貨合約或股票期權合約的持倉量？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責監察你遵守《合約限量及須申報的持倉量規則》下的申報規定的情況？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

存放於海外經紀行的客戶款項

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.12 | 假如你將為客戶在其他司法管轄區進行交易並將客戶款項存放於海外經紀行，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 你及你的客戶在進行該等海外交易時所承受的風險獲得妥善的管理； | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 透過海外經紀行進行交易所涉及的風險及時得到評估及監察； | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責評估及監察該風險？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 避免將過多的客戶款項存放於海外經紀行；及 | |  |  |  |
|  | d) | 向你的客戶解釋海外交易活動所涉及的風險，包括在海外持有的客戶資產未必可享有在香港持有的客戶資產所獲賦予的保障？ | |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否＂，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用＂，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**適用於股票期權交易活動**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.13 | 假如你將成為聯交所的期權交易所參與者，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保向客戶提供的期權交易確認書載有 | |  |  |  |
|  | a) | 已買入或已賣出的客戶合約或期權經紀客戶合約的數目、正股、到期月份、行使價、期權種類（認沽或認購）、版號，以及該等合約屬平倉合約還是開倉合約； |  |  |  |
|  | b) | 客戶合約或期權經紀客戶合約內所載的每手所包含的證券數目及有關價格； |  |  |  |
|  | c) | 大意如下的風險披露聲明：“期權可涉及高風險，因而未必適合每名投資者。投資者應確保其在參與期權市場前，已清楚暸解該等風險＂； |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 聲明你已在聯交所執行一張或以上的期權合約，而其條款與有關客戶合約或期權經紀客戶合約相同； |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 聲明假如你違責而導致該名客戶遭受金錢損失，該名客戶有權向根據該條例設立的投資者賠償基金索償，但須受到該投資者賠償基金不時制定的條款所規限；及 |  |  |  |
|  | f) | 聲明為或代客戶進行根據《期權交易規則》所界定的在交易所交易的期權業務（“在交易所交易的期權業務＂），一概須遵守聯交所的組織章程、《聯交所規則》、規例、聯交所的組織章程細則、聯交所的慣例及習慣、《期權交易規則》、聯交所期權結算所有限公司《結算規則》、中央結算及交收系統《一般規則》及香港法例的相關條文所規限，及該等條文對你及該名客戶雙方均具約束力？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.14 | 假如你將成為期權交易所參與者，並將接納代其他人從事在交易所交易的期權業務的人作為你的客戶，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 已以該名客戶的名義開立一個或多個綜合帳戶；及 |  |  |  |
|  | b) | 該名客戶在盡可能的範圍內計算出並向該等其他人收取適當的保證金（定義見《期權交易規則》）及期權金（定義見《期權交易規則》）？ |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**適用於期貨經紀活動**

抵銷安排

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.15 | 就客戶透過你開立的期貨交易帳戶和客戶透過你或你的聯屬公司開立的其他交易帳戶之間的抵銷安排，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 已向客戶披露該等抵銷安排的所有相關條款（包括可能須由客戶負擔的額外收費）和風險（包括持有未平倉合約所涉及的市場風險）；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 已向客戶傳達在甚麼情況下可在客戶的帳戶之間進行資金轉移（例如每次轉移資金前會否先取得客戶同意等）？ |  |  |  |

以獨立帳戶處理期交所交易及非期交所交易

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.16 | 如果你將會成為期交所的交易所參與者以進行期交所交易和非期交所交易，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 維持至少兩個獨立銀行帳戶； |  |  |  |
|  | b) | 與期交所交易有關的所有客戶款項存入其中一個指定為“期交所交易”的獨立銀行帳戶內； |  |  |  |
|  | c) | 與非期交所交易有關的客戶款項，則必須存入指定為“非期交所交易”的另一個獨立銀行帳戶內；及 |  |  |  |
|  | d) | 就每名客戶的所有期交所交易、所有非期交所交易及所有與期貨合約交易業務無關的其他交易，設立獨立的分類帳？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | |  | | | | **是** | **否\*** | | **不適用#** |
| 對固有客戶的評估 | | | | | |  |  | |  |
|  | | | | | |  |  | |  |
| 2.17 | | 如果你將會把你的客戶歸類為“固有客戶”，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | | |  |  | |  |
|  | | a) | | 你的客戶在被視為固有客戶之前符合以下條件； | |  | |  | |  |
|  | |  | | i) | 顯示過往有貫徹履行保證金責任 |  | |  |  |
|  | |  | | ii) | 維持穩健的財務狀況 |  | |  |  |
|  | |  | |  |  |  | |  |  |
|  | | b) | | 對固有客戶的資格進行持續檢視； | |  | |  |  |
|  | |  | | i) | 你將每隔多久進行該檢視？ |  | |  |  |
|  | |  | |  |  |  | |  |  |
|  |  | | ii) | | 誰人將負責進行該檢視？（如有，請註明職銜及姓名。） |  | |  |  |
|  |  | |  | |  |  | |  |  |
|  |  | |  | | |  | |  |  |
|  | c) | | 如果你的固有客戶過往僅進行即日平倉交易，便不會代其進行任何即日平倉交易，直至及除非你已從該固有客戶收取足以涵蓋最低按金要求的抵押品為止；及 | | |  | |  |  |
|  |  | |  | | |  | |  |  |
|  | d) | | 為固有客戶妥善記載和備存相關的評估及審批文件？ | | |  | |  |  |
|  |  | | i) | | 誰人將負責對固有客戶進行相關評估和審批？（如有，請註明職銜及姓名。） |  | |  |  |
|  |  | |  | |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |

保證金政策

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.18 | 你的保證金政策及程序所涵蓋的以下事項是否清楚列明並予以記錄及執行？ | |  |  |  |
|  | a) | 可追繳的保證金類別、適用的保證金比率及保證金的計算方法 |  |  |  |
|  | b) | 可接受的保證金繳付方法及抵押品的形式 |  |  |  |
|  | c) | 追繳保證金的方法 |  |  |  |
|  | d) | 在何種情況下，你的客戶可能被要求繳付保證金及額外的保證金，及未能繳付保證金的後果（包括你有權採取的行動） |  |  |  |
|  | e) | 向客戶收取短欠的保證金數額的方式 |  |  |  |
|  | f) | 倘若你的客戶連續多次未能補足被追繳的保證金，你將會採納的漸趨強硬的追繳程序 |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.19 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保在設定向你的客戶收取的初始保證金的融資比率時，已考慮到 | |  |  |  |
|  | a) | 交易所設立的初始保證金規定； |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | |  | | | **是** | **否\*** | | **不適用#** |
|  | b) | | 你的客戶的以下個別情況；及 | |  | |  |  |
|  |  | | i) | 信貸能力 |  | |  |  |
|  |  | | ii) | 財政狀況 |  | |  |  |
|  |  | | iii) | 投資目標 |  | |  |  |
|  |  | | iv) | 投資經驗和交易紀錄 |  | |  |  |
|  |  | |  | |  | |  |  |
|  | c) | | 產品類別？ | |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.20 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保在設定向你的客戶收取的維持保證金的融資比率時，已考慮到 | | | | |  | |  | | |  |
|  |  | | | | |  | |  | | |  |
|  | a) | 交易所設立的維持保證金規定； | | | |  | |  | | |  |
|  | b) | 你的客戶的以下個別情況；及 | | | |  | |  | | |  |
|  |  | i) | | | 信貸能力 |  | |  | | |  |
|  |  | ii) | | | 財政狀況 |  | |  | | |  |
|  |  | iii) | | | 投資目標 |  | |  | | |  |
|  |  | iv) | | | 投資經驗和交易紀錄 |  | |  | | |  |
|  | c) | 產品類別？ | | | |  | |  | | |  |
|  |  |  | | | |  | |  | | |  |
| 2.21 | 誰人將負責（如有，請註明職銜及姓名。） | | | | |  |  | | | |  |
|  |  | | | | |  |  | |  | | |
|  | a) | | 初始保證金的融資比率的批核； | | |  |  | |  | | |
|  |  | |  | | |  |  | |  | | |
|  |  | |  | | |  |  | |  | | |
|  | b) | | 對批予客戶的初始保證金的融資比率的檢視； | | |  |  | |  | | |
|  |  | |  | | |  |  | |  | | |
|  |  | | i) | 你將每隔多久進行該檢視？ | |  | |  | |  | |
|  |  | |  |  | |  | |  | |  | |
|  |  | |  |  | |  | |  | |  | |
|  | c) | | 維持保證金的融資比率的批核；及 | | |  |  | |  | | |
|  |  | |  | | |  |  | |  | | |
|  |  | |  | | |  |  | |  | | |
|  | d) | | 對批予客戶的維持保證金的融資比率的檢視？ | | |  |  | |  | | |
|  |  | |  | | |  |  | |  | | |
|  |  | | i) | 你將每隔多久進行該檢視？ | |  | |  | |  | |
|  |  | |  |  | |  | |  | |  | |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | | | **是** | **否\*** | **不適用#** |
| 追繳保證金通知 | | | |  |  |  |
|  | | | |  |  |  |
| 2.22 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 審慎地設定發出追繳保證金通知的觸發水平，請註明： | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 就固有客戶在存入最低保證金之前所開立的新持倉，於開立新持倉的營業日結束時或之前，發出追繳保證金通知； | |  |  |  |
|  | c) | 追繳保證金通知將會在達致觸發水平時立即發出； | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責監察你的客戶的保證金情況？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責發出追繳保證金通知？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | iii) | 誰人將負責監督追繳保證金通知的發出？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 保證金通知會獲及時跟進； | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責跟進追繳保證金通知？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 持續監察你的客戶是否有能力履行任何追繳保證金通知； | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久監察你的客戶繳付保證金的能力？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行該監察？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | f) | 適當地設定清繳保證金的最長酌情時限； | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責設定清繳保證金的時限？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | g) | 倘若你將會成為期交所的交易所參與者，如你的客戶連續兩次或以上未能繳付保證金或未應要求作出《期交所規則》所界定的變價調整（“變價調整”），而所涉金額合共超過150,000港元，便向期交所發出通知（當中載有出現拖欠情況的戶口號碼、合約數目（如適用）及所進行交易的市場的詳情）； | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | | **是** | **否\*** | **不適用#** |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | h) | 倘若你的客戶未能繳付保證金或未應要求作出變價調整，便對遵從《證券及期貨(財政資源)規則》的情況進行影響分析和執行流動性管理；及 | |  |  |  |
|  |  | i) | 誰人將負責檢視該影響分析及監督流動性管理？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | i) | 你備存有足以記錄向每位客戶發出的所有追繳保證金通知的詳情（包括每宗需發出的保證金通知、已發出的追繳保證金通知的詳情、客戶對追繳保證金通知的回應及所採取的任何跟進行動）的紀錄？誰人將負責檢視你的保證金追繳紀錄？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.23 | 請指明發出追繳保證金通知的方法。 | | | |  | |  | |  | |
|  | a) | | 經電郵 | |  | |  | |  | |
|  | b) | | 經短訊服務或其他即時通訊應用程式 | |  | |  | |  | |
|  | c) | | 經信件 | |  | |  | |  | |
|  | d) | | 經傳真 | |  | |  | |  | |
|  | e) | | 經電話 | |  | |  | |  | |
|  | f) | | 親身通知 | |  | |  | |  | |
|  | g) | | 其他，請註明： | |  | |  | |  | |
|  |  | |  | |  | |  | |  | |
|  | | | |  | |  | |  | |
| 2.24 | | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保將你的保證金追繳政策妥善傳達予客戶？  如是的話，你將如何向客戶傳達保證金追繳政策？ | | |  | |  | |  | |
|  | | a) | 載於客戶協議內 | |  | |  | |  | |
|  | | b) | 載於網站 | |  | |  | |  | |
|  | | c) | 載於另外發給客戶的信件或文件內 | |  | |  | |  | |
|  | |  |  | |  | |  | |  | |
|  | | d) | 其他，請註明： | |  | |  | |  | |
|  | |  |  | |  | |  | |  | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.25 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保為持續監察你的客戶的持倉情況而擬備管理報告，當中清楚列明 | |  |  |  |
|  | a) | 每名客戶的交易帳戶的財政狀況； |  |  |  |
|  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 每名客戶的未平倉合約； |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 每名客戶的交易帳戶的保證金情況； |  |  |  |
|  | d) | 向每名保證金客戶追繳保證金的情況；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | e) | 在每名客戶的交易帳戶內所注意到的任何例外情況？ |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 2.26 | 誰人將負責檢視第2.25條所述的報告？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |
|  | |  |  | |

強行變現

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.27 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 你的強行變現政策已妥善傳達予客戶；  如是的話，你將如何向客戶傳達你的強行變現政策？ | |  |  |  |
|  |  | i) | 載於客戶協議內 |  |  |  |
|  |  | ii) | 載於風險披露聲明內 |  |  |  |
|  |  | iii) | 載於網站 |  |  |  |
|  |  | iv) | 由工作人員向客戶進行口頭說明 |  |  |  |
|  |  | v) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 審慎地設定強行變現的觸發水平，請註明： | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | c) | 強行變現的觸發水平會定期進行檢視； | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久進行該檢視？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | d) | 強行變現須事先獲得核准；及 | | | |  |  |  |
|  |  | i) | | 誰人將負責強行變現的批核？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  |  |  | |  | |  |  |  |
|  |  |  | | | |  |  |  |
|  | e) | 在執行強行變現之前通知客戶？  如是的話，你將如何通知客戶？ | | | |  |  |  |
|  |  | i) | 經電郵 | | |  |  |  |
|  |  | ii) | 經短訊服務或其他即時通訊應用程式 | | |  |  |  |
|  |  | iii) | 經信件 | | |  |  |  |
|  |  | iv) | 經傳真 | | |  |  |  |
|  |  | v) | 經電話 | | |  |  |  |
|  | | | | | | **是** | **否\*** | **不適用#** |
|  | | | | | |  |  |  |
|  |  | vi) | 親身通知 | | |  |  |  |
|  |  | vii) | 其他，請註明： | | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  | |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.28 | 誰人將負責監督強行變現？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |

簿冊及帳目

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.29 | 如果你將會成為期交所的交易所參與者，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保適當簿冊及紀錄正確及清晰地記錄以下事項（其他事項除外）得以備存？ | | | | | | | |  | |  | |  |
|  | a) | 每名客戶的交易帳戶的財政狀況 | | | | | | |  | |  | |  |
|  | b) | 你和你的每名客戶的所有未平倉合約的詳情（即不單是未平倉合約淨額） | | | | | | |  | |  | |  |
|  | c) | 你不時存放於結算所和每名執行代理人的保證金款額 | | | | | | |  | |  | |  |
|  | d) | 你向結算所和每名執行代理人繳付的變價調整數額 | | | | | | |  | |  | |  |
|  | e) | 每名客戶所存放或規定需存放的保證金數額 | | | | | | |  | |  | |  |
|  | f) | 從客戶所收取或規定需從客戶收取的變價調整數額 | | | | | | |  | |  | |  |
|  | g) | 你為符合保證金規定而收取或持有的所有款項及資產 | | | | | | |  | |  | |  |
|  | h) | 所有追繳保證金通知及繳付變價調整的要求的詳情 | | | | | | |  | |  | |  |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  | |  | |
|  | i) | 期交所不時規定須保存在你的簿冊及紀錄內的任何其他詳情 | | | | | | |  | |  | |  |

委託帳戶管理活動

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.30 | 如果你將會向客戶提供委託帳戶管理服務，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 假如委託帳戶內的權益淨額跌低於客戶書面所訂明的金額，或假如在連續三個或少於三個連續交易日的任何期間內，權益淨額相對於該期間開始時的水平跌去超過50%， | |  |  |  |
|  |  | i) | 以書面通知你的客戶有關權益淨額的水平；及 |  |  |  |
|  |  | ii) | 除非就事後所進行的每宗交易都獲得客戶的事前書面同意，否則在委託帳戶的權益淨額超過所訂明的數額或回復到在該段期間開始時所處的水平之前，不會就該委託帳戶展開任何新的交易（把現有的未平倉合約平倉者除外）； |  |  |  |
|  | b) | 不會代表委託帳戶接納、處理或展開在任何市場內所進行的超過兩宗即日平倉買賣；及 | |  |  |  |
|  | c) | 不可在委託帳戶內開立期權短倉持倉？ | |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**其他事項**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.31 | 如果你將會以香港以外的海外投資者為對象，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保遵守該等其他司法管轄區的規則及規例？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.32 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保當你招攬客戶時，經考慮你所察覺的或經適當查證後理應察覺的關於該客戶的資料後，而向該客戶作出的招攬行為在所有情況下都是合理的？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.33 | 如果你將會向客戶提供投資建議，請也填妥本問卷第I部分第2.26及2.27條。 |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.34 | 如果你將會向客戶提供委託帳戶管理服務，請也回答本問卷第I部分第2.1至2.22條（如適用）。 |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

**第III部分：證券保證金融資**

|  |
| --- |
| **第1部：業務概況** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否** | | |
|  |  | |  |  |  |  |  |  |  |  |  | | |
| 1.1 | | 請指明你的證券保證金融資業務在首六個月的預計保證金貸款的規模（請以港元為單位）。 | | | | | | | | |  |  | |
|  | | |  | | | | | | | |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.2 | 請指明你的證券保證金融資業務的資金來源。 | | |  |  |
|  |  | | |  |  |
|  | a) | 銀行借貸  如是的話，請指明就銀行借貸提供的保證的種類。 | |  |  |
|  |  | i) | 無抵押（即無抵押融通） |  |  |
|  |  | ii) | 你的集團公司或股東擔保 |  |  |
|  |  | iii) | 其他人擔保，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  | iv) | 你的集團公司或股東提供的證券 |  |  |
|  |  | v) | 你提供的證券 |  |  |
|  |  | vi) | 保證金客戶提供的證券 |  |  |
|  |  | vii) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 你的自有資金 | |  |  |
|  | c) | 從你的集團公司獲得的財務援助 | |  |  |
|  | d) | 其他，請註明： | |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.3 | 請指明你是否會再質押客戶的證券抵押品。  如是的話，請指明你將會再質押客戶的證券抵押品予哪些機構或人士。 | |  |  |
|  |  | |  |  |
|  | a) | 認可財務機構 |  |  |
|  | b) | 持牌中介人 |  |  |
|  | c) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.4 | 請指明你接納的抵押品形式。 | | | | | | | | |  | |  | |
|  |  | | | | | | | | |  | |  | |
|  | a) | | 香港上市股票 | | | | | | |  | |  | |
|  |  | |  | | | | | | |  | |  | |
|  |  |  | |  |  |  |  |  |  | | **是** | | **否** |
|  |  | |  | | | | | | |  | |  | |
|  | b) | | 海外上市股票，請註明交易所： | | | | | | |  | |  | |
|  |  | |  | | | | | | |  | |  | |
|  |  | |  | | | | | | |  | |  | |
|  | c) | | 其他形式的抵押品，請註明： | | | | | | |  | |  | |
|  |  | |  | | | | | | |  | |  | |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

|  |
| --- |
| **第2部：內部監控** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**信貸限額**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.1 | 你是否已設有書面保證金借貸政策及監控程序，以確保 | |  |  | |  | |
|  | a) | 經考慮你的流動資金狀況和資本、保證金貸款組合的風險狀況及當時的市況後，實施審慎的保證金貸款總額上限； |  | |  | |  | |
|  | b) | 保證金貸款總額上限受到定期檢視；及 |  | |  | |  | |
|  | c) | 密切監察保證金貸款總額上限是否獲得遵從，並且會對任何嚴重違反有關上限的事件及時作出跟進並將有關事件向高級管理層上報？ |  | |  | |  | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.2 | 你是否已設有書面保證金借貸政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 經考慮保證金客戶的資產淨值或收入淨額後，向該保證金客戶批授信貸限額； |  |  |  |
|  | b) | 保證金客戶信貸限額受到定期檢視；及 |  |  |  |
|  | c) | 密切監察保證金客戶信貸限額是否獲得遵從，並且會對任何嚴重違反有關限額的事件及時作出跟進並將有關事件向高級管理層上報？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.3 | 你是否已設有書面保證金借貸政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 妥善識別關連保證金客戶組別；及 |  |  |  |
|  | b) | 妥善監察客戶集中風險限額就個別保證金客戶或關連保證金客戶組別所承擔的風險，以避免在每名保證金客戶或各個關連保證金客戶組別方面積累過大的風險？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.4 | 你的高級管理層將每隔多久檢視 | |  |  |  |
|  | a) | 保證金貸款總額上限；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 保證金客戶信貸限額？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.5 | 誰人將負責以下範疇的職能？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  | a) | 對保證金貸款上限的監察 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 對保證金客戶信貸限額的監察 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 保證金客戶集中風險管理 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**追繳保證金通知及強行變現**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.6 | 你是否已設有書面保證金借貸政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 審慎地設定發出追繳保證金通知和停止向客戶提供進一步貸款的觸發水平； | |  |  |  |
|  | b) | 當未償還保證金貸款超過持有的證券抵押品的保證金價值或向客戶授予的信貸限額，便會立即發出追繳保證金通知； | |  |  |  |
|  | c) | 倘若發生以下情況，便不會向保證金客戶提供進一步貸款； | |  |  |  |
|  |  | i) | 仍有未清償的追繳保證金 |  |  |  |
|  |  | ii) | 客戶的未清償保證金貸款的餘額高於相關抵押品的市值 |  |  |  |
|  | d) | 備存適當及詳盡的紀錄，以確保過往對個別客戶追繳保證金的紀錄一目了然；及 | |  |  |  |
|  | e) | 發出追繳保證金通知和停止提供進一步貸款的觸發水平會由你的高級管理層定期進行檢視？ | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.7 | 你是否已設有書面保證金借貸政策及監控程序，以確保 | | | |  |  |  |
|  | a) | | 你的強行變現政策妥善傳達予保證金客戶； | |  |  |  |
|  |  | | 如是的話，你將如何向客戶傳達你的強行變現政策？ | |  |  |  |
|  |  | | i) | 載於客戶協議內 |  |  |  |
|  |  | | ii) | 載於風險披露聲明內 |  |  |  |
|  |  | | iii) | 載於網站 |  |  |  |
|  |  | | iv) | 由工作人員向客戶進行口頭說明 |  |  |  |
|  |  | | v) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  | |  |  |  |  |  |
|  |  | |  | |  |  |  |
|  | b) | | 審慎地設定強行變現的觸發水平； | |  |  |  |
|  | c) | | 定期進行檢視強行變現的觸發水平； | |  |  |  |
|  | d) | | 在執行強行變現前通知客戶；及 | |  |  |  |
|  |  | | 如是的話，你將如何通知你的保證金客戶？ | |  |  |  |
|  |  | | i) | 經電郵 |  |  |  |
|  |  | | ii) | 經短訊服務或其他即時通訊應用程式 |  |  |  |
|  |  | | iii) | 經信件 |  |  |  |
|  |  | | iv) | 經傳真 |  |  |  |
|  |  | | v) | 經電話 |  |  |  |
|  | |  | vi) | 親身通知 |  |  |  |
|  | |  | vii) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  | |  |  |  |  |  |  |
|  | |  |  | |  |  |  |
|  | | e) | 強行變現乃基於對保證金客戶而言的最佳條件而執行？ | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.8 | 你將每隔多久檢視 | |  |  |  | | |
|  | a) | 發出追繳保證金通知和停止提供進一步貸款的觸發水平；及 |  | | |  |  | |
|  |  |  |  | | |  |  | |
|  |  |  |  | | |  |  | |
|  | b) | 強行變現的觸發水平？ |  | | |  |  | |
|  |  |  |  | | |  |  | |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.9 | 誰人將負責監督（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  | a) | 追繳保證金通知及停止提供進一步貸款；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 強行變現？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**抵押品管理**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.10 | 你是否已設有書面保證金借貸政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 備存可接納的證券抵押品清單； |  |  |  |
|  | b) | 將適當的扣減率應用在每項可接納為抵押品的證券，並顧及該等證券在當時市況下的流通性和價格波幅，以及相關證券的發行人的財務狀況； |  |  |  |
|  | c) | 設定集中風險限額以避免在個別證券抵押品或高度相互關連證券抵押品組別方面積累過大的風險；及 |  |  |  |
|  | d) | 監察集中的抵押品持倉量的變化？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.11 | 如果你再質押客戶的證券抵押品，你是否已設有任何書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 在你為保證金客戶開立保證金帳戶時，你會告知客戶其做法； |  |  |  |
|  | b) | 在給予你的保證金客戶的書面通知內，於顯眼位置載入一項有關提供將證券抵押品再質押的授權書的風險披露聲明； |  |  |  |
|  | c) | 向保證金客戶取得再質押其證券抵押品的適當書面授權；及 |  |  |  |
|  | d) | 再質押證券抵押品的金額受到監察並維持低於保證金貸款總額的140% 的水平？ |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 2.12 | 誰人將負責證券抵押品集中風險管理的職能？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |
|  | |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 2.13 | 誰人將負責證券保證金借貸業務的整體監管？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |
|  | |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |
| --- |
| **第3部：其他** |

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 3.1 | 你的保證金客戶協議是否載有 | |  |  |  |
|  | a) | 《操守準則》第6.2(f)段所規定的計算保證金的詳細規定、利息費用、追繳保證金的規定及在什麼情況下持牌人或註冊人可無需該客戶同意而將客戶的持倉出售或平倉； |  |  |  |
|  | b) | 《操守準則》附表1所列有關“保證金買賣的風險”的風險披露聲明；及 |  |  |  |
|  | c) | 《操守準則》附表1所列有關提供將證券抵押品再質押的授權書的風險披露聲明？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 3.2 | 如果銀行借貸是你的證券保證金融資業務的其中一項資金來源，你是否已設有書面政策及監控程序以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 你不會過度依賴銀行借貸作為你的資金來源； |  |  |  |
|  | b) | 在根據你的銀行信貸融通提取而未清繳的借款餘額受到監察；及 |  |  |  |
|  | c) | 每當你的銀行信貸融通提取而未清繳的借款餘額已在連續兩個星期的期間相等於或超過該等銀行信貸融通的信貸總額度的80%，你須於一個營業日內以書面形式通知證監會？ |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

**第IV部分：電子交易或自動化交易服務**

|  |
| --- |
| **第1部：業務概況** |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |  |  |
| 1.1 | 請指明你的電子交易系統將會提供的服務類型。 | | |  |  |
|  | a) | 傳遞買賣指示 | |  |  |
|  |  | i) | 證券 |  |  |
|  |  | ii) | 期貨合約 |  |  |
|  | b) | 營運另類交易平台 | |  |  |
|  | c) | 營運首次公開招股前交易平台 | |  |  |
|  | d) | 買賣槓桿式外匯合約 | |  |  |
|  | e) | 就認購、轉換及贖回基金發出指示 | |  |  |
|  | f) | 電子認購服務（例如電子招股服務） | |  |  |
|  | g) | 追蹤投資組合表現 | |  |  |
|  | h) | 市場報價 | |  |  |
|  | i) | 其他，請註明： | |  |  |
|  |  |  | |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.2 | 請指明你的系統的性質。 | |  |  |
|  | a) | 買賣指示傳遞系統 |  |  |
|  | b) | 電子通訊網絡 |  |  |
|  | c) | 互聯網入門網站 |  |  |
|  | d) | 交易平台 |  |  |
|  | e) | 其他，請註明： |  |  |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.3 | | 請指明你擬向客戶提供的電子交易服務類型。 | | |  |  |
|  | | a) | 互聯網交易 | |  |  |
|  | | b) | 直達市場安排 | |  |  |
|  | | c) | 程式買賣 | |  |  |
|  |  | | | | **是** | **否** |
| 1.4 | | 請指明你的電子交易系統是否 | | |  |  |
|  | | a) | 屬自行開發；或 | |  |  |
|  | | b) | 由第三方服務提供者提供。請註明 | |  |  |
|  | |  | i) | 系統發展商或應用服務供應商的名稱： |  |  |
|  | |  |  |  |  |  |
|  | |  | ii) | 負責網絡保安管理的公司的名稱： |  |  |
|  | |  |  |  |  |  |
|  |  | | | |  |  |
| 1.5 | 如果你的電子交易系統由第三方服務提供者提供，請指明你是否已與有關服務提供者訂立正式的服務協議，而當中訂明服務條款及提供者的責任。 | | | |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.6 | 請指明你以下設備設於何處。 | |  |  |
|  | a) | 主伺服器 |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 後備伺服器 |  |  |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.7 | 請提供流程圖以演示你擬提供的電子交易服務的運作。請在該圖表內 | |  |
|  | a) | 描述電子交易系統的主要特點； |  |
|  | b) | 顯示不同機構和人士如何與該系統（例如你、客戶、交易所）互動；及 |  |
|  | c) | 說明與透過該系統處理的買賣指示的接收、執行、結算和交收（如適用）有關的所有步驟。 |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 互聯網交易（如果你對第1.3a)條的回答為“是”，請填妥第1.8及1.9條） |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.8 | 請指明你的客戶可如何進入電子交易系統。 | |  |  |
|  | a) | 你的網站，請註明網站地址： |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  | b) | 流動應用程式，請註明你的流動應用程式的名稱： |  |  |
|  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.9 | 請指明你的網站或流動應用程式是否 | |  |  |
|  | a) | 列明你的名稱、牌照或註冊狀況、中央編號和交易所買賣參與者資格（如適用）； |  |  |
|  | b) | 載有接駁至以香港投資者為對象的海外網站的任何超連結；及 |  |  |
|  |  |  | **是** | **否** |
|  |  |  |  |  |
|  | c) | 載有接駁至其他公司的超連結，以便客戶與該等公司開戶。 |  |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 直達市場安排（如果你對第1.3b)條的回答為“是”，請填妥第1.10條） |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.10 | 請指明你是否有意准許你的客戶將直達市場安排服務下的權力再轉授予其他人。  如是的話，請註明其他人（例如基金公司）的性質： | |  |  |
|  | |  |  |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 程式買賣（如果你對第1.3c)條的回答為“是”，請填妥第1.11條） |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.11 | 請指明你有意採用的程式策略的類型。 | |  |  |
|  | a) | 成交量加權平均價 |  |  | |
|  | b) | 時間加權平均價 |  |  | |
|  | c) | 其他（請註明）： |  |  | |
|  |  |  |  |  | |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 另類交易平台（如果你對第1.1b)條的回答為“是”，請填妥第1.12及1.13條） |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.12 | 請指明你的另類交易平台是否會處理《操守準則》第19.2段所界定的你的“自營買賣指示”。 |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 1.13 | 請指明你是否有意將你的另類交易平台上的客戶買賣指示傳遞給其他外部場所執行。  如是的話，請註明該場所： | |  |  |
|  | |  |  |  |

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| 首次公開招股前交易平台（如果你對第1.1c)條的回答為“是”，請填妥第1.14條） |  |  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 1.14 | 請指明你的首次公開招股前交易平台擬設定的交易時間。 | |  |
|  | |  |  | |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

|  |
| --- |
| **第2部：內部監控** |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**一般監控**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.1 | 你是否已就你的電子交易系統的運作設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 在交易、風險及合規部門共同參與下實施正式的管治程序； |  |  |  |
|  | b) | 設有清楚界定的匯報途徑，將監督和匯報職責指派予合適的職員執行；及 |  |  |  |
|  | c) | 訂有管理監控措施及監督管制措施，用以管理與電子交易系統的使用相關的風險？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.2 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 設有網絡保安風險管理框架，當中列明網絡保安管理層的主要角色及責任； |  |  |  |
|  | b) | 懷疑或確實的網絡保安事故的上報及向內和向外（例如客戶、證監會及其他執法機構）報告；及 |  |  |  |
|  | c) | 至少每年向所有內部系統使用者提供足夠的網絡保安意識培訓？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.3 | 誰人將負責（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  | a) | 電子交易系統的整體管理和監督；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 網絡保安管理和監督？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.4 | 請指明上面第2.3a)條內所述人士是否為你的負責人員？ |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**系統的安全性**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.5 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  |  | | |  |  |  |
|  | a) | 透過妥善的網絡隔離措施（即設有多重防火牆的隔離區）來配置安全的網絡基礎設施； | |  |  |  |
|  | b) | 只容許有需要的人士有權接達或使用系統； | |  |  |  |
|  | c) | 實施可靠的技術，藉以認證或核實系統使用者的身分及權限； | |  |  |  |
|  |  | i) | 最短的密碼長度 |  |  |  |
|  |  | ii) | 向客戶發出定期更改密碼的周期性提示 |  |  |  |
|  |  | iii) | 最低的密碼複雜程度（即同時包含字母與數字），及重用舊密碼前須更改密碼的次數 |  |  |  |
|  |  | iv) | 針對無效的登入嘗試採取適當的監控措施 |  |  |  |
|  |  | v) | 網頁在閒置一段時間後被設定為已超時 |  |  |  |
|  |  | vi) | 客戶的登入密碼由系統在啟動帳戶及重設密碼的過程中隨機產生 |  |  |  |
|  |  | vii) | 雙重認證解決方案 |  |  |  |
|  |  | viii) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | d) | 只容許有需要的人士遙距接達其內部網絡，並對遙距接達實施保安監控措施； | |  |  |  |
|  | e) | 及時監察和評估軟件提供者發布的保安修補程式或修正程式； | |  |  |  |
|  | f) | 及時執行和更新防毒及抗惡意軟件解決方案，以偵測關鍵系統伺服器及工作站內的惡意應用程式及惡意軟件； | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久更新防毒及抗惡意軟件解決方案？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  | g) | 實施適當的運作監控措施以防止及偵測未經授權的入侵、違反保安事件及對安  全性的攻擊； |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | h) | 關鍵系統組件（例如系統伺服器及網絡裝置）放置在只有認可人員方可進入的上鎖房間內；及 |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | i) | 至少每天將業務紀錄、客戶及交易數據庫、伺服器及證明文件在離線媒體進行備份？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.6 | 請指明你將為客戶登入互聯網交易過程實施的雙重認證解決方案。 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | a) | 硬件編碼器 |  |  |  |
|  | b) | 軟件編碼器 |  |  |  |
|  | c) | 一次性密碼短訊 |  |  |  |
|  | d) | 生物特徵識別技術（例如指紋識別） |  |  |  |
|  | e) | 其他，請註明： |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  | | | | |
|  | | | | |
|  | |  | **是** | **否\*** | **不適用#** | |

**系統的監控、容量及可靠性**

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.7 | 你是否已就你的電子交易系統的穩健性設有書面政策及監控程序，以確保 | | | |  |  |  |
|  | a) | 你在有需要時可 | | |  |  |  |
|  |  | i) | 即時制止系統產生及向市場傳送買賣指示；及 | |  |  |  |
|  |  | ii) | 取消市場上任何尚未執行的買賣指示； | |  |  |  |
|  | b) | 電子交易系統及對系統的所有改動在應用前均經過測試； | | |  |  |  |
|  | c) | 定期檢視電子交易系統及對系統的所有改動，以確保其可靠性； | | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久檢視電子交易系統？ | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行該檢視？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  |  |  |  | |  |  |  |
|  | d) | 及時通知證監會與電子交易系統有關的任何重大的服務中斷或其他重要問題； | | |  |  |  |
|  |  |  | |  | |  |  |
|  | e) | 定期監察電子交易系統的容量使用情況，並進行適當的容量規劃； | |  | |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久檢視電子交易系統的容量使用情況？ |  | |  |  |
|  |  |  |  |  | |  |  |
|  |  |  |  |  | |  |  |
|  | f) | 定期對電子交易系統的容量在不同的模擬市況下進行壓力測試；及 | |  | |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久進行壓力測試？ |  | |  |  |
|  |  |  |  |  | |  |  |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行壓力測試？（如有，請註明職銜及姓名。） |  | |  |  |
|  |  |  |  |  | |  |  |
|  |  |  |  |  | |  |  |
|  | g) | 電子交易系統的容量足以處理在營業額及市場成交量方面任何可預見的增長？ | | |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**應變措施**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.8 | 你是否已設有包括以下事項的書面應變計劃，以處理與電子交易系統有關的緊急情況及中斷事故？ | |  |  |  |
|  | a) | 適當的後備設施，以便可以在緊急情況下提供電子交易服務或其他執行買賣指示的安排 |  |  |  |
|  | b) | 備份安排（包括執行買賣指示和備存業務紀錄、客戶及交易數據庫、伺服器及其他證明文件） |  |  |  |
|  | c) | 由經過培訓的員工處理客戶及監管當局查詢的計劃 |  |  |  |
|  | d) | 在辦公室以外地方設有配備妥善保安措施的儲存設施 |  |  |  |
|  | e) | 確保重大系統延誤或故障得以糾正，及時通知客戶發生重大系統延誤或故障的原因或可能原因，並將會如何處理客戶的買賣指示的安排 |  |  |  |
|  | f) | 應對可能出現的網絡攻擊情境的政策 |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.9 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保定期測試你的應變計劃並且有關計劃是可行的？ | |  |  |  |
|  | a) | 你將每隔多久進行應變計劃的測試？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 誰人將負責應變計劃的測試？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**備存紀錄**

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.10 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保就以下文件資料備存妥善的紀錄？ | |  |  |  |
|  | a) | 有關你的系統的設計及開發（包括任何測試、檢視、改動、升級或糾正）的文件，為期不少於該系統停止運作後兩年 |  |  |  |
|  | b) | 有關你的系統的風險管理監控措施的文件，為期不少於該系統停止運作後兩年 |  |  |  |
|  | c) | 你的系統活動的稽查紀錄，為期不少於兩年 |  |  |  |
|  | d) | 有關你的系統的所有重大系統延誤或故障的事故報告，為期不少於兩年 |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**風險管理**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.11 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保傳送至有關基礎設施的客戶買賣指示受到下述事項所規限？ | | |  |  |  |
|  | a) | 為以下目的而設計的適當的自動化交易前風險管理監控措施 | |  |  |  |
|  |  | i) | 防止輸入任何可能導致超逾為每名客戶或每個自營帳戶所訂明的適當交易及信貸限額的買賣指示 |  |  |  |
|  |  | ii) | 就輸入可能是錯誤的買賣指示向使用者發出警示，並防止輸入錯誤的買賣指示 |  |  |  |
|  |  | iii) | 防止輸入違反監管規定的買賣指示 |  |  |  |
|  |  | iv) | 其他（請註明）： |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  |  |  | |  |  |  |
|  | b) | 定期進行交易後監察，以識別出任何可能屬操縱或違規性質的買賣指示及交易 | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.12 | 誰人將負責有關電子交易系統的風險管理職能？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  | |
|  | |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**直達市場安排**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.13 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 在向客戶提供直達市場安排服務前評估該客戶是否符合有關的基本要求，包括 | |  |  |  |
|  |  | i) | 該客戶設有適當安排，以確保其使用者能熟練地及勝任地操作直達市場安排服務的系統； |  |  |  |
|  |  | ii) | 該客戶理解並有能力符合適用的監管規定；及 |  |  |  |
|  |  | iii) | 該客戶設有足夠安排，以監察透過直達市場安排服務輸入的買賣指示； |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | b) | 不時因應當前市況評估對客戶的基本要求；及 | |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |
|  | c) | 定期評估該名使用其直達市場安排服務的客戶是否繼續符合對客戶的基本要求？ | |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.14 | 如果你對第1.10條的回答為“是”，你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 該人的買賣指示會通過你的客戶的系統，並受到適當的風險管理監控措施及監督管制措施所規限； |  |  |  |
|  | b) | 該人符合你對客戶的基本要求；及 |  |  |  |
|  | c) | 你的客戶與該人之間訂有一份書面協議，列明再轉授的直達市場安排服務的條款？ |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**程式買賣**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.15 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保參與設計及開發你的程式買賣系統及買賣程式的人士具備合適的資格？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.16 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保獲核准使用你的程式買賣系統的人士 | |  |  |  |
|  | a) | 充分了解該程式買賣系統及該等買賣程式的運作； |  |  |  |
|  | b) | 充分了解在使用該程式買賣系統及該等買賣程式的過程中可能出現的合規及監管事宜； |  |  |  |
|  | c) | 及時獲悉有關該程式買賣系統及該等買賣程式在設計及開發方面的任何改變；及 |  |  |  |
|  | d) | 獲提供有關操作該程式買賣系統的最新的文件？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.17 | 誰人將負責批准程式買賣系統的使用？（如有，請註明職銜及姓名。） | |  | |  |  | |
|  | |  |  |  | | |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.18 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | | |  |  |  |
|  | a) | 該程式買賣系統和該等買賣程式，以及日後的任何開發及改動，在應用前均經過充分測試；及 | |  |  |  |
|  | b) | 對該程式買賣系統及該等買賣程式定期進行檢視及測試，以評估該程式買賣系統能否處理相當大的成交量，以及該等買賣程式能否在不干擾市場公平有序的運作的情況下執行買賣指示？ | |  |  |  |
|  |  | i) | 你將每隔多久對該程式買賣系統及該等買賣程式進行檢視？ |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  | ii) | 誰人將負責進行該等檢視？（如有，請註明職銜及姓名。） |  |  |  |
|  |  |  |  |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
|  | **是** | **否\*** | **不適用#** |

**另類交易平台**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.19 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保只有《操守準則》第19.2段所界定的“合資格投資者”獲准成為另類交易平台的用戶？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.20 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保 | |  |  |  |
|  | a) | 擬備及在你的網站登載有關你的另類交易平台的詳盡而準確的另類交易平台指引； |  |  |  |
|  | b) | 透過向用戶提供你的另類交易平台指引，確保用戶充分知悉你的另類交易平台的運作形式；及 |  |  |  |
|  | c) | 對你的另類交易平台指引作出必要的修訂或更新，以確保其內容維持全面、準確及合時？ |  |  |  |

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.21 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保當用戶的買賣指示及自營買賣指示以相同價格進行交易時，用戶的買賣指示會較自營買賣指示獲優先處理？ | |  |  |  | |
|  |  | |  |  |  |
|  |  | |  |  |  |
|  | | **是** | | **否\*** | **不適用#** | |
|  | |  | |  |  | |
| 2.22 | 你是否已設有書面政策及監控程序，以確保在你的另類交易平台上已執行的交易的資料適當地向你的另類交易平台的用戶、交易所、證監會及其他監管機構匯報或供其閱覽？ | |  |  |  | |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

**首次公開招股前交易平台**

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
| 2.23 | 你是否已設有書面政策及監控程序，確保已獲得有關首次公開招股前的股票的賣方有足夠可供交收的股份的保證？ |  |  |  |

**補充資料**

|  |
| --- |
|  |

**\* 如上述任何問題的答案為“否”，請於以下空白位置詳細描述任何能夠與有關問題所提述的監控措施達致相同目標的替代或補足監控措施。**

|  |
| --- |
|  |

**# 如上述任何問題的答案為“不適用”，請於以下空白位置說明為何該問題並不適用。**

|  |
| --- |
|  |

**第V部分：聲明**

**我們：**

* **聲明**在本問卷及一同遞交的任何文件內所提供的全部資料均為完整、真實及正確。
* **明白**在本問卷或為支持本問卷提供虛假或具誤導性的資料可能觸犯該條例第383及／或384條的罪行。
* **明白**證監會可以對在本問卷、或為支持本問卷而作出虛假或具誤導性陳述的人士採取刑事行動及／或作出紀律處分。
* **明白**如果本問卷或一同遞交的任何文件所載的任何資料在證監會就任何相關申請作出決定前發生變更，我們應立即以書面形式通知證監會該等變更。
* **明白**證監會可作出其認為適當的該等查詢及索取其認為適當的進一步資料。

**（本聲明須由法團的兩名董事\*或獲董事局授權人士簽署。）**

|  |  |
| --- | --- |
| **代表：** |  |
|  | 持牌法團／持牌法團申請人名稱 | |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |
| 董事／獲董事局授權人士\*\* 姓名 |  | 簽署 |  | 日期 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|  |  |  |  |  |
| 董事／獲董事局授權人士\*\* 姓名 |  | 簽署 |  | 日期 |

\* 如法團只有一名董事，可由一名董事簽署。

\*\* 請刪去不適用者。