

表格

(為遵守《證券及期貨條例》(第571章)第156(1)(a)條，即在《證券及期貨(帳目及審計)規則》(第 571P 章)第 3(1) 條所闡述的規定的目的而訂立)

持牌法團的業務及風險管理問卷

持牌法團名稱：

(“持牌法團”)

財政年度結束日期：

經由以下人士填寫：

姓名： _____

職銜： _____

電話號碼： _____

經由以下人士核准：

姓名： _____

職銜： _____

電話號碼： _____

前言

根據《證券及期貨(帳目及審計)規則》，持牌法團必須填寫業務及風險管理問卷，並在財政年度結束後 4 個月內，將問卷連同其經審計的帳目呈交證券及期貨事務監察委員會(“證監會”)。業務及風險管理問卷旨在收集有關持牌法團的業務運作及風險管理措施的資料，包括為確保持牌法團遵守適用於它們的監管規定而採取的監控措施及有關程序。本問卷亦可用作為持牌法團的一種自我評估工具，以瞭解其本身業務運作及評估有關風險管理措施及內部監控。證監會期望持牌法團盡其所知填寫本問卷，以確保能夠如實地反映它們的運作及監控措施。

證監會注意到由於有持牌法團的業務活動的性質和範圍、其組織和法律架構以及管理層監察的程度存在着重大的差異，因而可能會採納不同的政策及程序。因此，本問卷中的問題並非打算暗示(而且亦不應詮釋作為)有一套普遍認可的監控或風險管理措施。

我們已在每一節預留空白位置，供持牌法團就其回覆提供額外資料。如有需要，請另加紙繼續作答。

除非附有定義或文意另有所指，本問卷中所使用的詞語具有《證券及期貨條例》給予該等詞語的涵義。如你對本問卷有任何疑問，請與本會中介機構監察科內有關人員聯絡。

填妥的業務及風險管理問卷應送交予：

證券及期貨事務監察委員會
中介機構監察科
香港皇后大道中二號
長江集團中心三十五樓

證券及期貨事務監察委員會

持牌法團的業務及風險管理問卷

I. 業務概覽

1. 年內所進行的受規管活動: (請在適當的□內加✓)

- | | | |
|--------|-----------|--------------------------|
| (i) | 證券交易 | <input type="checkbox"/> |
| (ii) | 期貨合約交易 | <input type="checkbox"/> |
| (iii) | 槓桿式外匯交易 | <input type="checkbox"/> |
| (iv) | 就證券提供意見 | <input type="checkbox"/> |
| (v) | 就期貨合約提供意見 | <input type="checkbox"/> |
| (vi) | 就機構融資提供意見 | <input type="checkbox"/> |
| (vii) | 提供自動化交易服務 | <input type="checkbox"/> |
| (viii) | 提供證券保證金融資 | <input type="checkbox"/> |
| (ix) | 提供資產管理 | <input type="checkbox"/> |
| (x) | 提供信貸評級服務 | <input type="checkbox"/> |

2. 持牌法團在年內所進行的業務活動: (請在適當的□內加✓)

(i) 從事自營交易 (如“是”，請同時回答問題 35 - 38)

- | | | |
|-----|----------|--------------------------|
| (a) | 證券 | <input type="checkbox"/> |
| (b) | 期貨合約 | <input type="checkbox"/> |
| (c) | 場外衍生產品 | <input type="checkbox"/> |
| (d) | 其他 (請說明) | <input type="checkbox"/> |

(ii) 為以下帳戶／人士從事實空活動:

- | | | |
|-----|---------|--------------------------|
| (a) | 法團本身的帳戶 | <input type="checkbox"/> |
| (b) | 客戶 | <input type="checkbox"/> |

(iii) 為以下帳戶／人士從事證券借貸:

- | | | |
|-----|---------|--------------------------|
| (a) | 法團本身的帳戶 | <input type="checkbox"/> |
| (b) | 客戶 | <input type="checkbox"/> |

補充資料

管理及監督

是 否 不適用

3. 持牌法團是否容許職員同時執行前線辦公室職能(例如交易)及後勤辦公室職能(例如交收或會計職能)?

如“是”，請說明為了盡量減低出現潛在錯誤、利益衝突或違規情況而採取的監控措施。

	是	否	不適用
4. 持牌法團是否備有關於重大業務活動的政策及程序？	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
5. 持牌法團的管理層有否審閱有關以下業務範圍的業務及管理及／或特別資料或報告？			
(i) 整體業績表現	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(ii) 穩妥保管客戶資產	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(iii) 監察速動資金的情況	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

如有，持牌法團的管理層就審閱以下業務範圍的資料或報告的頻密程度：

- (i) 整體業績表現
- (ii) 穩妥保管客戶資產
- (iii) 監察速動資金的情況

分行運作 (只適用於有分行在香港營運的持牌法團)

6. (i) 持牌法團的分行直接負責以下範疇的工作：			
(a) 開立帳戶	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(b) 穩妥保管客戶資產	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(c) 交易	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(d) 信貸管制	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(e) 交收，例如存取現金／證券	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(f) 交付成交單據，戶口結單及收據	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(g) 處理客戶投訴	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(ii) 持牌法團的分行是否受到：			
(a) 總公司管理層的實地視察	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(b) 內部審計部門的審核	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(c) 監察部門的審核	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

如“是”，請說明進行以下工作的頻密程度

- (a) 總公司管理層的實地視察
- (b) 內部審計部門的審核
- (c) 監察部門的審核

是 否 不適用

(iii) 持牌法團是否設有程序規定其客戶須就以下類別的查詢或投訴與總公司聯絡？

- | | | | |
|------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (a) 客戶的交易 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (b) 由持牌法團持有的客戶資產 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (c) 成交單據、戶口結單及收據 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (d) 分行的運作 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

補充資料

II. 風險管理

營運風險

處理客戶帳戶

7. 持牌法團是否有為取得有關其客戶的下述資料(根據適用的守則及其他規限而需提供的資料) 而設的程序

- | | | | |
|-------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (i) 客戶身分？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 財務背景？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iii) 投資經驗？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iv) 投資目標？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

8. 持牌法團是否設有程序，以確保客戶資料(例如通訊地址)的修改

- | | | | |
|----------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (i) 已取得客戶的書面指示？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 經由前線職員以外的職員所核對？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

9. 持牌法團的標準客戶協議中有否註明持牌法團有權在客戶無法償還其對持牌法團的債務時處置此客戶的資產？

10. 持牌法團是否容許其客戶給予書面授權，使其職員能夠代客戶

- | | | | |
|-----------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (i) 發出買賣指示？；及／或 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 進行交收？；及／或 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iii) 收取成交單據、戶口結單及收據？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

如“是”，

- (i) 請說明曾給予該等書面授權的客戶數目，而該等書面授權在財政年度結束時仍維持有效。

- (ii) 管理層審核該等帳戶內的活動的頻密程度？
-
- | | 是 | 否 | 不適用 |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 11. 持牌法團是否有任何專業投資者的客戶？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 如“是”，請說明在財政年度結束時專業投資者的數目 | <hr/> | | |
| 12. 持牌法團是否有任何曾向其發出代存郵件指示的客戶？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 如“是”， | | | |
| (i) 請說明在財政年度結束時該等客戶的數目 | <hr/> | | |
| (ii) 持牌法團是否有任何為以下目的而設的程序 | | | |
| (a) 取得或延續客戶代存郵件的書面指示？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (b) 由前線職員以外的職員將客戶在指示上的簽署與該名客戶在簽署記錄上的簽名加以核實？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (c) 規定客戶或獲其授權的人士確認收妥客戶的成交單據、戶口結單及收據？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

補充資料

交易手法

13. 持牌法團是否容許其職員以下述方式收取客戶的買賣指示？
- | | | | |
|-----------------------------|--------------------------|--|--|
| (i) 面對面在辦公室內 | <input type="checkbox"/> | | |
| (ii) 以書面形式 (例：圖文傳真) | <input type="checkbox"/> | | |
| (iii) 透過固網電話 | <input type="checkbox"/> | | |
| (iv) 透過流動電話 | <input type="checkbox"/> | | |
| (v) 以電子形式 (例：互聯網、無線上網設施電話等) | <input type="checkbox"/> | | |
| (vi) 其他 (請說明) | <input type="checkbox"/> | | |
-
14. 持牌法團有否在交易記錄之上蓋上時間印章，以記錄以下時間(包括由電腦系統所發出的時間記錄)
- | | | | |
|-----------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (i) 收到買賣指示的時間？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 落盤執行買賣指示的時間？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iii) 交易對手或交易所執行／確認買賣指示的時間？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

- | | 是 | 否 | 不適用 |
|--|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 15. 持牌法團是否容許其職員透過以下人士／機構以便為其本身進行證券或期貨合約或其他金融產品的交易： | | | |
| (i) 持牌法團本身？及／或 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 其他中介人？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

如“是”，請說明持牌法團監察其職員的交易活動的頻密程度。

16. 請說明為確保能以公平方式將交易分配予客戶(尤其是當涉及只能部分完成的買賣指示)而設有的程序(例如先到先得、按比例分配等)。
-
-

- | | | | |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 17. 持牌法團是否有為確保由持牌法團或其職員所進行的全權委託的交易(包括集體投資計劃及為全權委託帳戶而持有的投資組合)符合客戶與持牌法團所協議的投資指引／目標及限制而設的程序？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------------------|

如“是”，請說明有關程序。

- | | | | |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 18. 持牌法團是否設有程序，以確保交叉盤交易是根據有關的監管規定而獲得適當的執行，以及得到管理層的定期審核？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------------------|

如有，請說明有關程序。

補充資料

資產保護

銀行及現金

19. (i) 持牌法團就以下帳戶進行銀行對帳的頻密程度：

- (a) 獨立帳戶？
(b) 其他銀行帳戶？

- (ii) 就銀行對帳時所發現的差異作出跟進行動的迅速程度？
-

是 否 不適用

(以下問題 20 至 24 適用於在香港收取或持有客戶款項的持牌法團)

- | | | | | |
|-----|--|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 20. | 持牌法團是否設有以下程序，以確保所有涉及支付給客戶的款項都得到適當處理 | | | |
| | (i) 取得來自客戶的恰當指示？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | (ii) 由前線職員以外的職員將客戶在指示上的簽署與該名客戶在簽署記錄上的簽名加以核實？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | (iii) 如指示是以電子記錄形式作出，確保《電子交易條例》的規定得到符合？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | (iv) 查察客戶帳戶內是否備有足夠款項？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | (v) 取得管理層的核准？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | (vi) 確保付款只供存入客戶或客戶以書面指示表示可收取有關款項的人的帳戶？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 21. | 持牌法團在支付與其受規管活動有關的款項時，有否向客戶支付現金或發出第三者支票？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | 如“是”，持牌法團會否在支付現金或發出第三者支票之前，要求取得 | | | |
| | (i) 客戶的書面授權？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | (ii) 管理層的批核？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 22. | (i) 持牌法團是否接受由客戶存入的第三者支票，包括由職員所開出的用來交收客戶的購入交易或支付未償還給持牌法團的債項的支票？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | (ii) 持牌法團是否有為識別其所收取的第三者支票(直接由客戶存入持牌法團的銀行帳戶的支票除外)而設的程序？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 23. | 持牌法團是否設有程序，以確保由客戶存入的支票／款項能按照指示正確地記錄入該客戶的帳戶？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 24. | 持牌法團是否容許不同的客戶就彼此之間的帳戶結餘進行轉移？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| | 如“是”，持牌法團是否有為查察該等轉移是否已獲得持牌法團適當的處理而設的程序？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

補充資料

是 否 不適用

證券(以下問題 25 至 30 只適用於在香港收取或持有客戶證券的持牌法團)

25. 持牌法團是否有任何客戶在與持牌法團進行交易時，使用由香港中央結算有限公司所提供的以下服務

	在財政年度結束 時的客戶數目			
附有提供結單服務的證券獨立帳戶？		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
投資者戶口持有人帳戶？		<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

26. 持牌法團是否代客戶持有實物證券？

是 否 不適用

如“是”，

(i) 有關證券是否以下列人士／機構的姓名或名稱註冊？

(a) 客戶	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(b) 持牌法團(如是證券抵押品)	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(c) 持牌法團的有聯繫實體	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(d) 香港中央結算(代理人)有限公司	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(e) 其他 (請說明)	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

(ii) 持牌法團是否有為限制哪些人士才可以進入存放該等證券的地方而設的程序？

是 否 不適用

(iii) 請說明點算實物證券的頻密程度。

(iv) 持牌法團是否有程序以記錄實物證券的提存？

是 否 不適用

27. (i) 持牌法團就證券進行對帳的頻密程度？

(ii) 就證券對帳時所發現的差異作出跟進行動的迅速程度？

28. 持牌法團會否就質押、借出或以其他方式處理客戶證券及／或證券抵押品取得客戶的常設授權？

是 否 不適用

如“是”，

(i) 是否設有任何記錄冊確保所有授權是持續有效的？

是 否 不適用

(ii) 是否設有任何程序以確保只有在獲得有效的授權時才會質押或借出客戶的證券？

是 否 不適用

29. 如客戶將實物證券存放於持牌法團，則持牌法團是否設有程序要求客戶須就其對證券的擁有權提供證明？

是 否 不適用

- | | 是 | 否 | 不適用 |
|-------------------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 30. 持牌法團是否容許不同的客戶在彼此的帳戶之間轉移證券？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 如“是”，持牌法團是否有為查察該等轉移是否已獲得適當的處理而設有程序？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

補充資料

信貸風險

- | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 31. 持牌法團是否有為評核及監察每個客戶或交易對手的信貸狀況而設的程序？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 32. 持牌法團是否有關於以下範疇的政策及程序？ | | | |
| (i) 及時向客戶作出催繳保證金通知／還款通知 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 處理客戶因未能按照催繳保證金通知繳付保證金或未能按還款通知償付款項所引致的後果 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iii) 定期就特別情況向管理層作出報告 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iv) 強制性地替客戶平倉 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (v) 就催繳保證金通知或還款通知備存記錄 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (vii) 定期檢討持牌法團所接納的證券的借貸比例 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 33. 客戶或交易對手如有巨額的未交收交易或長期未清繳的結餘，是否仍會獲准進行交易（滾存結餘現金客戶及具備足夠抵押品的保證金客戶除外）？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| 如“是”，請說明有關的監控程序及就這些客戶或交易對手所採取的跟進行動。 | | | |
-
-

- | | | | |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 34. 持牌法團有否設有程序就以下風險集中的情況作出管理，並定期向管理層匯報？ | | | |
| (i) 因某客戶或某群相關客戶而承受的風險 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 因某交易對手或某群相關的交易對手而承受的風險 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iii) 因某投資產品而承受的風險 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

如“是”，請說明管理層進行有關檢視的頻密程度。

補充資料

市場風險	是	否	不適用
35. 持牌法團有否就其自營交易設有以下範疇的政策及程序？			
(i) 清楚界定的交易權限	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(ii) 設定交易及風險限額	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(iii) 由管理層進行監察，以確保自營交易的金額保持在限額之內	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(iv) 在超過限額時應採取的措施，及適用的制裁	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(v) 為其自營交易持倉而設的對沖策略	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(vi) 定期進行壓力測試，以計算因不斷轉變的市況對持牌法團所帶來的影響	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
36. 持牌法團是否就以下範疇設有風險管理職能？			
(i) 業績評估	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(ii) 價格核證	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(iii) 模式風險監察	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(iv) 風險管理方法及系統	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(v) 新產品	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
如以上任何一個問題的答案為“是”的話，有關的風險管理職能是否			
(i) 由具備適當知識及經驗的僱員負責執行？	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(ii) 獨立於前線辦公室及直接向高層管理人員匯報？	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
37. 持牌法團有否採納任何風險定價模式，例如風險值(Value-at-Risk)、股本模式經濟價值(Economic value of Equity Models)等，作為主要的風險評估及管理的工具？	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
如“是”，持牌法團是否有就以下各項制訂政策及程序：			
(a) 測試及認可前線及後勤辦公室人員使用的風險定價模式及估值系統	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(b) 對修改、發出、更新及維持風險定價模式進行監控	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(c) 定期使用現有數據反覆進行測試，以核證模式的準確性	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
38. 持牌法團是否就以下範疇備有資料可供管理層監察其自營交易的情況？			
(i) 盈虧	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(ii) 風險水平	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(iii) 風險數值	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(iv) 限額的使用	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(v) 壓力測試／模擬測試	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>
(vi) 經進行風險調節的表現	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>	<input type="checkbox"/>

流動資金風險

39. 持牌法團就以下各項作出預測的頻密程度

- (i) 流動現金？
- (ii) 交收責任？

是 否 不適用

40. 持牌法團是否設有向管理層及負責管理流動資金的職員就以下事項發出預警而設的程序

- (i) 持牌法團所使用的資金來源出現任何重大潛在的短缺(例如客戶無能力進行交收、銀行信貸額下降)？
- (ii) 持牌法團對資金的需求出現大幅上升的潛在可能(例如支付按照證券市值計算的差額)？

41. 請說明管理層檢視可供使用資金的頻密程度。

補充資料

監察風險

42. 持牌法團是否設有指定的功能負責監督及處理以下範疇的事宜？

- (i) 客戶投訴
- (ii) 遵守監管規定
- (iii) 清洗黑錢
- (iv) 持續專業培訓規定

如“否”，請說明有關的替代安排：

43. 持牌法團是否設有以下職能？

- (i) 內部審計
- (ii) 監察

如“是”，請說明有關內部審計及／或監察的匯報途徑

是 否 不適用

44. 持牌法團在過去 12 個月內曾否收到有關以下範疇的嚴重客戶投訴，聲稱

- | | | | |
|---|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (i) 沒有收到收據，成交單據及／或戶口結單？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 未經授權而進行交易？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iii) 戶口結單上的帳戶結餘及／或證券持有量出現錯誤(有關價格及收費的爭議除外)？ | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

衍生工具持倉及申報限額

45. 持牌法團是否設有為確保以下規則獲得遵守而設的程序？

- | | | | |
|--|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| (i) 《證券及期貨(合約限量及須申報的持倉量)規則》 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (ii) 香港期貨交易所有限公司的申報限額規定 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |
| (iii) 香港聯合交易所有限公司就交易所買賣期權業務所訂立的持倉及申報限額規定 | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> | <input type="checkbox"/> |

如“是”，請說明有關程序。

補充資料

清洗黑錢

46. 持牌法團有否在管理層內設立一個樞紐，負責收集個別職員提供的有關可疑交易的情報，以進行覆檢及向聯合財富情報組 (Joint Financial Intelligence Unit) 作出報告？

47. 持牌法團為職員提供打擊清洗黑錢的培訓的次數？

補充資料

信貸評級服務（只適用於在香港提供信貸評級服務的持牌法團）

48. 持牌法團的操守準則是否全面落實《提供信貸評級服務人士的操守準則》的條文？

如否，請註明存在偏差的地方及原因，並說明能達致《提供信貸評級服務人士的操守準則》所載的各項目標的替代安排。
