

第 609 號公告

證券及期貨條例 (第 571 章) (‘該條例’)

(根據第 134(6)(a) 條規定發出的公告)

證券及期貨事務監察委員會已依據該條例第 134(1) 條 (‘對規定作出修改或寬免’) 所賦予的權力，就以下人士而對根據該條例第 145 條訂立的《證券及期貨 (財政資源) 規則》的規定作出寬免。

名稱	作出寬免的日期	有效期
巴克萊亞洲有限公司 (‘巴克萊亞洲’)	2008 年 1 月 24 日	有效期至作出修訂或撤銷為止

證監會就巴克萊亞洲有關其與客戶訂立的交易所買賣股票或指數的交易所涉及的總回報掉期，對《證券及期貨 (財政資源) 規則》(‘《財政資源規則》’) 第 55(4) 條的規定作出寬免。

有關寬免受以下條件所規限：

有效期至作出修訂或撤銷為止

- (a) 巴克萊亞洲須在察覺到巴克萊亞洲就其任何客戶的總回報掉期指示所承擔的風險未按《財政資源規則》第 37(c) 條的規定就每宗交易完全進行對沖後的兩個營業日內，以書面方式將持倉的詳情通知證監會；以及
- (b) 巴克萊亞洲須在察覺到其為支持有關申請而作出的任何陳述在要項上是或已變成虛假或具誤導性後的兩個營業日內，將此事通知證監會。

*作出寬免的理由*

基於巴克萊亞洲使證監會信納，作出巴克萊亞洲所要求的有關寬免不會損害投資大眾的利益，證監會已在考慮過巴克萊亞洲就其與客戶訂立的交易所買賣股票或指數的交易所涉及的總回報掉期而制定的對沖安排後，作出有關的寬免。

2008 年 1 月 24 日

證券及期貨事務監察委員會  
中介團體及投資產品部副總監曹愛蓮