

第 7721 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》的規定作出修改。

名稱	作出修改的日期	有效期
高盛 (亞洲) 有限責任公司 (「高盛亞洲」)	2006 年 11 月 30 日	有效期至作出修訂或撤銷為止

證監會就高盛亞洲在韓國股本掛鉤權證市場內進行的莊家活動而對《證券及期貨 (財政資源) 規則》第 2、27(1)(d)、28(3)、40(4)(a)、43(2) 及 44 條的規定作出修改。

有關修改按照以下條件作出

有效期至作出修訂或撤銷為止

- (1) 如高盛亞洲察覺下列規則下的適用條文有任何修訂，高盛亞洲必須立即以書面通知證監會，並呈交相關的資料：
 - (i) 韓國金融監督管理局發出的《監督證券業務的規例》；及
 - (ii) 韓國金融監督管理局發出的《監督證券業務的規例的詳細執行規則》；
- (2) 如高盛亞洲決定選擇採納內部模型分析法而非 Delta-plus 分析法來計算韓國金融監督管理局發出的《監督證券業務的規例》所訂明的市場風險資本規定，高盛亞洲必須立即通知證監會；
- (3) 如高盛亞洲察覺韓國的有關監管機構提出任何有關高盛亞洲在韓國股本掛鉤權證市場內進行的莊家活動的重大事宜，高盛亞洲必須立即通知證監會；
- (4) 高盛亞洲須取得其控股公司 The Goldman Sachs Group, Inc. 的承諾，當中 The Goldman Sachs Group, Inc. 承諾管理和支持高盛亞洲，確保高盛亞洲能時刻應付有關其在韓國權證市場內進行的莊家活動的財政責任；
- (5) 高盛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；
- (6) 就高盛亞洲的莊家活動而言，高盛亞洲只可購買在韓國獲發牌，並且須接受韓國金融監督管理局的審慎監督及行為操守監督的證券商號所發行的權證；及

名稱	作出修改的日期	有效期
(7) 高盛亞洲必須以按照《證券及期貨(財政資源)規則》向證監會提交的財政資源申報表的補充資料形式，向證監會提交關於在每個曆月終結時的下列事項的資料：(i) 為在韓國進行的莊家活動而購買的權證的數目、市值及名義價值；及(ii) 為該等莊家活動的對沖而賣空的證券及持有的期貨好／淡倉合約的市值。		

作出修改的理由

基於高盛亞洲使證監會信納，作出有關修改不會損害投資大眾的利益，證監會亦在考慮到高盛亞洲的業務性質及所有其他情況後，認為要求高盛亞洲遵守《證券及期貨(財政資源)規則》的有關規定會對其構成過分沉重的負擔，因此證監會作出有關修改。

2006年11月30日

證券及期貨事務監察委員會
 中介團體監察科副總監文尹淑嫻