

(翻譯本)

本局檔號：B9/135C

致：所有持牌銀行  
行政總裁

敬啟者：

### 場外衍生工具交易——第二階段匯報

《2016年證券及期貨(場外衍生工具交易——匯報及備存紀錄責任)(修訂)規則》將於2017年7月1日生效。因應業界的查詢，金管局現就其對載於該《規則》的匯報規定的籌備工作、測試及事故應變安排，尤其對於擬透過代理人作匯報的實體而言的相關預期作出澄清。本通告應與金管局於2017年1月27日發出有關使用電子匯報系統的培訓及測試要求的通告(見附件)一併閱讀。

#### 直接向香港交易資料儲存庫匯報

計劃直接向香港交易資料儲存庫(「儲存庫」)匯報的受規管實體<sup>1</sup>，除了須符合儲存庫的其他要求外，亦須於2017年5月31日前完成模擬測試(包括情景測試及產品特定測試)(若其尚未進行有關測試)，以便其根據第二階段的規定所作出的場外衍生工具產品匯報獲得接納。

#### 透過代理人向儲存庫匯報

計劃透過代理人作匯報的實體必須留意匯報責任仍然會由該受規管實體承擔。聘用代理人作匯報的認可機構應採取所有合理措施，以確保有關匯報符合《規則》的所有規定。認可機構尤其應該：

---

<sup>1</sup> 受規管實體意指《規則》所指的訂明人士：  
(a)認可財務機構(認可機構)；(b)核准貨幣經紀；(c)持牌法團；(d)認可結算所；以及(e)自動化交易服務中央對手方。

- (a) 作出所有必要安排，向代理人提供其所需的格式及所有適用的相關資料，從而讓代理人能代表其向儲存庫匯報，並確保在第二階段匯報實施前，就有關安排進行有效及全面的測試；
- (b) 要求代理人作出向儲存庫匯報的所有必要安排，並遵照儲存庫的所有要求及在規定的時限內就有關安排進行有效及全面的測試；
- (c) 對代理人的業務持續運作及其他後備安排進行充足的盡職審查，以應對代理人的匯報服務可能因故受到干擾；
- (d) 利用儲存庫提供的技術選項<sup>2</sup>與儲存庫建立直接聯繫渠道。若實體(不論直接或透過代理人匯報)已參與使用儲存庫的匯報服務，並已符合儲存庫對成員的所有要求，有關實體與儲存庫之間將會建立聯繫渠道，以便(i) 提交交易事件(經用戶界面上載)；(ii) 查詢有關交易及交易事件詳情；以及(iii)取閱報告(如「不確定未能連結交易報告」及「差異報告」)及收取通知等。透過代理人匯報的實體亦可在代理人匯報服務出現問題，而又未能迅速以代理人的業務持續運作或其他安排解決有關問題的情況下，利用此渠道直接向儲存庫傳送(符合儲存庫要求的)交易報告；
- (e) 在 2017 年 5 月 31 日或之前與儲存庫完成情景測試(即模擬測試第 1 部)(若該實體尚未進行有關測試)。在第 1 階段匯報及/或暫行匯報期間已完成此測試的實體無需再次進行此測試；以及
- (f) 考慮完成產品特定測試(即模擬測試第 2 部)。尤其若實體已決定採取直接匯報作為應變計劃，以應付透過代理人匯報出現問題的情況，更應在 2017 年 5 月 31 日或之前完成產品特定測試。

金管局並不預期透過代理人匯報的認可機構備有在代理人出現在《規則》生效前未能預見之困難時，可向儲存庫直接匯報的全面運作後備安排。換言之，金管局並不預期該等認可機構複製與代理人訂約提供的整個匯報系統及服務。然而，一旦出現有關困難，金管局會考慮認可機構是否已採取合理措施，以遵循上文列載有關籌備工作、測試及盡職審查的要求。

---

<sup>2</sup> 儲存庫會在認可機構要求時提供有關選項的資料。

貴機構如對儲存庫的程序及本通函有任何問題，請聯絡儲存庫，電話號碼為(852)8100-3115，電郵地址為 [hktr@hkma.gov.hk](mailto:hktr@hkma.gov.hk)。

主管(金融市場基建監察及牌照審批)  
祈能賢

2017年4月27日

連附件