



《證券及期貨條例》(第 571 章)

《證券及期貨(財政資源)規則》(第 571N 章)

* [1000] 財務申報表 (附註 1)

(為遵守《證券及期貨條例》(第 571 章) 第 145 條·即在《證券及期貨(財政資源)規則》(第 571N 章) (《財政資源規則》) 第 56 條所闡述的規定)

表格 1 速動資金計算表

| | | | |
|-----|---|---|----------|
| (1) | 持牌法團名稱 | <input type="text"/> | [1001] |
| | 中央編號 | <input type="text"/> | [1002] |
| (2) | 業務名稱 (如有別於第 (1) 項) | <input type="text"/> | [1003] |
| (3) | 申報月份 (mm/yyyy) | <input type="text"/> / <input type="text"/> | [1004] |
| | 如本財務申報表並非就截至曆月的月終日期止的 期間編製·請指明申報日期 (dd/mmm/yyyy) | <input type="text"/> | [1005] |
| (4) | 持牌法團獲發牌進行的受規管活動 / 虛擬資產服務類別 (請選擇適用者·可選擇多於一項) | | |
| | 第 1 類 : | | |
| | (a) 證券交易·及該法團不提供證券保證金融資 | <input type="checkbox"/> | [1006A] |
| | (b) 證券交易·及該法團提供證券保證金融資 | <input type="checkbox"/> | [1006B] |
| | (c) 僅以買賣商身分進行證券交易 | <input type="checkbox"/> | [1006C] |
| | (d) 僅以核准介紹代理人身分進行證券交易 | <input type="checkbox"/> | [1006D] |
| | 第 2 類 : | | |
| | (a) 期貨合約交易 | <input type="checkbox"/> | [1006E] |
| | (b) 以期貨非結算交易商身分進行期貨合約交易 | <input type="checkbox"/> | [1006F] |
| | (c) 僅以買賣商身分進行期貨合約交易 | <input type="checkbox"/> | [1006G] |
| | (d) 僅以核准介紹代理人身分進行期貨合約交易 | <input type="checkbox"/> | [1006H] |
| | 第 3 類 : | | |
| | (a) 槓桿式外匯交易 | <input type="checkbox"/> | [1006I] |
| | (b) 僅以核准介紹代理人身分進行槓桿式外匯交易 | <input type="checkbox"/> | [1006J] |
| | 第 4 類 : | | |
| | (a) 就證券提供意見·及該法團受指明發牌條件規限 (附註 2) | <input type="checkbox"/> | [1006K] |
| | (b) 就證券提供意見·及該法團不受指明發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006L] |
| | 第 5 類 : | | |
| | (a) 就期貨合約提供意見·及該法團受指明發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006M] |
| | (b) 就期貨合約提供意見·及該法團不受指明發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006N] |
| | 第 6 類 : | | |
| | (a) 就機構融資提供意見·及該法團受指明發牌條件規限但不受不任保薦人發牌條件規限 (附註 2) | <input type="checkbox"/> | [1006O] |
| | (b) 就機構融資提供意見·及該法團受指明發牌條件和任保薦人發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006O1] |
| | (c) 就機構融資提供意見·及該法團不受指明發牌條件規限但受不任保薦人發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006P] |
| | (d) 就機構融資提供意見·及該法團不受指明發牌條件和任保薦人發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006P1] |
| | 第 7 類 : | | |
| | 提供自動化交易服務 | <input type="checkbox"/> | [1006Q] |
| | 第 8 類 : | | |
| | 提供證券保證金融資 | <input type="checkbox"/> | [1006R] |
| | 第 9 類 : | | |
| | (a) 提供資產管理·及該法團受指明發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006S] |
| | (b) 提供資產管理·及該法團不受指明發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006T] |
| | 第 10 類 : | | |
| | (a) 提供信貸評級服務·及該法團受指明發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006U] |
| | (b) 提供信貸評級服務·及該法團不受指明發牌條件規限 | <input type="checkbox"/> | [1006V] |
| | 第 13 類 : | | |
| | 為相關集體投資計劃提供存管服務 | <input type="checkbox"/> | [1006V1] |
| | 根據《打擊洗錢及恐怖分子資金籌集條例》(《打擊洗錢條例》) 獲發牌成為持牌提供者 (附註 1A) | <input type="checkbox"/> | [1006W] |
| | 附註 1 : 凡持牌法團就以下一類或多於一類受規管活動獲發牌: 就證券提供意見·就期貨合約提供意見·就機構融資提供意見·提供資產管理及/或提供信貸評級服務·及凡該法團受指明發牌條件規限·該法團須按半年期的基準呈交本財務申報表·其他持牌法團須按月呈交本財務申報表·但須按每季基準呈交的若干表格則除外·有關適用於持牌法團的呈交規定·請參閱《證券及期貨(財政資源)規則》第 56 條。 | | |
| | 附註 1A : 本財務申報表亦是為遵守根據《打擊洗錢條例》第 53ZTK 條公布的《適用於虛擬資產交易平台營運者的指引》第 6.5 段的規定的目的而作出的·在本財務申報表中·“持牌法團”亦指根據《打擊洗錢條例》獲發牌的持牌提供者。 | | |
| | 附註 2 : 有關“指明發牌條件”及“不任保薦人發牌條件”的定義·請參閱《證券及期貨(財政資源)規則》第 2(1) 條。 | | |
| | * 請選擇適用者 | | |

| 項 | 資產 | 條次 (附註 3) | 列入速動資 金計算表內 的數額 | | 列入資產 負債表內 的數額 | |
|-----|--|-----------------|-----------------------|------------|---------------------|------------|
| | | | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) |
| 5 | 手頭現金及銀行存款 - 在獨立帳戶內持有的銀行結餘 - 在其他帳戶內持有的銀行結餘及手頭現金 (附註 4) | 20 | [1007] | 0 | 0 | [1008] |
| | | | [1009] | 0 | 0 | [1010] |
| 6 | 應從保證金客戶收取的款項 (附註 5) | 22(1) 及 (2) | [1011] | 0 | 0 | [1012] |
| 7 | 就證券認購而應從客戶收取的款項 | 21(5) | [1013] | 0 | 0 | [1014] |
| 8 | 應從滾存結餘現金客戶收取的款項 | 21(2)、(3) 及 (6) | [1015] | 0 | 0 | [1016] |
| 9 | 因證券交易而產生的應從客戶收取的其他款項 | 21(1)、(4) 及 (6) | [1017] | 0 | 0 | [1018] |
| 10 | 應從就提供證券保證金融資獲發牌的持牌法團 收取的款項 | 24(2) 及 25 | [1019] | 0 | 0 | [1020] |
| 11 | 證券及指明投資項目的自營交易持倉 (附註 6) | 27 | [1021] | 0 | 0 | [1022] |
| 12 | 在交易所買賣的非上市期權合約的自營交易持倉 | 31 | [1023] | 0 | 0 | [1024] |
| 12A | 虛擬資產的自營交易持倉 (附註6B) | | [1024A] | 0 | 0 | [1024B] |
| 13 | 因在交易所買賣的非上市期權合約的交易而產生的應從 客戶收取的款項 | 30 | [1025] | 0 | 0 | [1026] |
| 14 | 就證券而應從其他交易商及結算所參與者等收取的款項 | 23 及 24(1) | [1027] | 0 | 0 | [1028] |
| 15 | 就期貨合約、非上市期權合約及槓桿式外匯交易合約而 應從其他交易商及結算所參與者收取的款項 | 29 | [1029] | 0 | 0 | [1030] |
| 16 | 應從結算所收取的款項 | 28 | [1031] | 0 | 0 | [1032] |
| | - 香港中央結算有限公司 | | [1033] | 0 | 0 | [1034] |
| | - 香港聯合交易所期權結算所有限公司 | | [1035] | 0 | 0 | [1036] |
| | - 香港期貨結算有限公司 | | [1037] | 0 | 0 | [1038] |
| | - Euroclear Bank S.A./N.V.、 Euroclear France S.A.、 Clearstream Banking S.A.、 Clearstream Banking AG 或 Korea Securities Finance Corporation | | [1039] | 0 | 0 | [1040] |
| | - 其他結算所 | | [1040A] | 0 | 0 | [1040B] |
| 16A | 應從虛擬資產交易平台收取的款項 -根據《打擊洗錢條例》獲發牌的持牌提供者 -虛擬資產交易平台 (根據《打擊洗錢條例》獲發牌的持牌提供者除外) | | [1040C] | 0 | 0 | [1040D] |
| 17 | 因槓桿式外匯交易而產生的應從認可對手方收取 的款項及就未平倉持倉的浮動利潤 | 34 | [1041] | 0 | 0 | [1042] |
| 18 | 因下列項目而產生的其他資產 | 26、32、33 及 35 | [1043] | 0 | 0 | [1044] |
| | - 就證券提供意見 及/或就期貨合約提供意見 | | [1045] | 0 | 0 | [1046] |
| | - 就機構融資提供意見 | | [1047] | 0 | 0 | [1048] |
| | - 提供資產管理 | | | | 0 | [1049] |
| | - 應從集團公司 或其他關連方收取的款項 | | [1049A] | 0 | 0 | [1049B] |
| | - 提供信貸評級服務 | | [1049C] | 0 | 0 | [1049D] |
| | - 證券借貸協議 | | [1049E] | 0 | 0 | [1049F] |
| | - 回購交易 | | [1049G] | 0 | 0 | [1049H] |
| | - 提供虛擬資產服務 | | [1049I] | 0 | 0 | [1049J] |
| | - 為相關集體投資計劃提供存管服務 | | | | 0 | [1049K] |
| | - 其他 | | [1050] | 0 | 0 | [1051] |
| 19 | 速動資產總值 (第 5 至 18 項的總和) | | [1052] | 0 | | |
| 20 | 固定資產 | | | | 0 | [1053] |
| 21 | 資產總值 (第 5 至 18 及 20 項的總和) | | | | 0 | [1054] |

| 項 | 負債 | 條次 (附註 3) | 列入速動資金 計算表內的數額 | | 列入資產負債 表內的數額 | |
|-----|--|---|-------------------|------------|-----------------|------------|
| | | | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) |
| 22 | 持牌法團為其本身持有的證券及投資項目的淡倉 | 43(1) | | | | |
| 23 | 應向客戶支付的款項 | 37 及 38 | [1055] | 0 | 0 | [1056] |
| 23A | 相關集體投資計劃的計劃款項及其他款項 | 37A | [1057] | 0 | 0 | [1058] |
| 24 | 因提供證券保證金融資予共同客戶而產生的應向證券交易商支付的款項 | 39(2) | [1058A] | 0 | 0 | [1058B] |
| 25 | 應向結算所支付的款項 - 香港中央結算有限公司 - 香港聯合交易所期權結算所有限公司 - 香港期貨結算有限公司 - Euroclear Bank S.A./N.V.、Euroclear France S.A.、Clearstream Banking S.A.、Clearstream Banking AG 或 Korea Securities Finance Corporation - 其他結算所 | 37 | [1059] | 0 | 0 | [1060] |
| | | | [1061] | 0 | 0 | [1062] |
| | | | [1063] | 0 | 0 | [1064] |
| | | | [1065] | 0 | 0 | [1066] |
| | | | [1067] | 0 | 0 | [1068] |
| | | | [1069] | 0 | 0 | [1070] |
| 26 | 就證券交易而應向就提供證券保證金融資獲發牌的持牌法團及其他證券交易商支付的款項 | 37 及 39(1) | | | | |
| | | | [1071] | 0 | 0 | [1072] |
| 27 | 就期貨合約交易及非上市期權合約的交易而應向其他交易商及結算所參與者支付的款項 | 37 | | | | |
| | | | [1073] | 0 | 0 | [1074] |
| 28 | 其他應付款項及負債 - 來自認可財務機構的貸款及透支 - 來自其他財務機構的貸款及透支 - 應向集團公司或其他關連方支付的款項 - 應向根據《打擊洗錢條例》獲發牌的持牌提供者支付的款項 - 應向虛擬資產交易平台(根據《打擊洗錢條例》獲發牌的持牌提供者除外)支付的款項 - 來自其他貸款人的貸款 - 根據證券借貸協議應向借用人支付的款額 - 在回購交易中售賣證券的代價數額 - 應算項目、應付款項及其他負債(核准後償貸款除外) | 45(4)、46(3)、53(1)(a)-(e) 及 (h) | [1075] | 0 | 0 | [1076] |
| | | | [1077] | 0 | 0 | [1078] |
| | | | [1079] | 0 | 0 | [1080] |
| | | | [1080AA] | 0 | 0 | [1080AB] |
| | | | [1080AC] | 0 | 0 | [1080AD] |
| | | | [1080AE] | 0 | 0 | [1080AF] |
| | | | [1080A] | 0 | 0 | [1080B] |
| | | | [1080C] | 0 | 0 | [1080D] |
| | | | [1081] | 0 | 0 | [1082] |
| 29 | 就或有負債及浮動虧損所提撥的準備金 | 41(1)(b)、53(1)(f) 及 (g) | [1083] | 0 | 0 | [1084] |
| | | | | | | [1085] |
| 30 | 核准後償貸款 | 53(2)(a) | | | | |
| 31 | 與以下項目有關的認可負債 - 就提供證券保證金融資的撥備比率調整 - 代客戶進行賣空證券交易 - 期貨合約及非上市期權合約(附註 7) - 保證金客戶的集中 - 就為持牌法團本身持有的淡倉而調高的數額 - 集中自備交易持倉 - 證券借貸及回購交易 - 向另一人介紹交易以便執行或結算 - 包銷承擔淨額 - 場外買賣衍生工具合約及掉期息率協議 - 擔保及其他財政承擔 - 外匯協議及外幣持倉量 - 就權證式外匯交易收取的保證金的短欠數額 - 其他認可負債 | 42(2) 43(10) 40 42(1) 43(2)-(9) 44 45(1)-(3) 及 (5)-(6)、46(1) 及 (2) 51 47 48 及 49 52(1)(a) 50 及 51A 41(1)(a) 及 41(2) 52(1)(b)-(d) 及 (e) | [1086] | 0 | | |
| | | | [1087] | 0 | | |
| | | | [1088] | 0 | | |
| | | | [1089] | 0 | | |
| | | | [1090] | 0 | | |
| | | | [1091] | 0 | | |
| | | | [1092] | 0 | | |
| | | | [1093] | 0 | | |
| | | | [1094] | 0 | | |
| | | | [1095] | 0 | | |
| | | | [1096] | 0 | | |
| | | | [1097] | 0 | | |
| | | | [1098] | 0 | | |
| | | | [1099] | 0 | | |
| 32 | 負債總額(第 22 至 30 項的合計總額) | | | | 0 | [1100] |
| 33 | 可贖回股份(核准可贖回股份除外) | 52(1)(c) | [1101] | 0 | | |
| 34 | 認可負債總額(第 22 至 29、31 及 33 項的合計總額) | | [1102] | 0 | | |
| 35 | 速動資金(第 19 項減去第 34 項所得之數) | | [1103] | 0 | | |
| 36 | 規定速動資金 | 2 | [1104] | 0 | | |
| 37 | 速動資金盈餘(規定速動資金短欠數額)(第 35 項減去第 36 項所得之數) | | [1105] | 0 | | |
| 38 | 股東資金(第 21 項減去第 32 項所得之數)(附註 8) | | | | 0 | [1106] |

附註 3：除另有指明外，本欄所提述的條次指《證券及期貨(財政資源)規則》中的條次，而該等提述旨在確定須列入本財務申報表內的數額。

附註 4：列入速動資產內的“在其他帳戶內持有的銀行結餘及手頭現金”的數額由下列各項組成：

銀行結餘 -

- 有產權負擔或已質押

- 沒有產權負擔

(HK\$'000)

0

0

[1107]

[1108]

手頭現金

0 [1109]

列入 1009 單元格內的數額

0 [1110]

在其他帳戶內持有最大筆款項總額的首 5 家認可財務機構或核准的在香港以外成立為法團的銀行

| 行 | 序 | 認可財務機構或核准的在香港以外成立為法團的銀行的名稱 | 所在處 | 有關機構或銀行是否持牌法團的聯屬公司? | 在其他帳戶內持有的款項 (HK\$'000) | 行 |
|-----|---|----------------------------|-----|---------------------|------------------------|-----|
| [1] | 1 | | | | 0 | [1] |
| [2] | 2 | | | | 0 | [2] |
| [3] | 3 | | | | 0 | [3] |
| [4] | 4 | | | | 0 | [4] |
| [5] | 5 | | | | 0 | [5] |

附註 5：第 22(2) 條所指的保證金短欠數額按以下基準計算：
(請選擇適用者)

附註 6：自營交易持倉分析

(A) 證券及指明投資項目的自營交易持倉分析 - 按產品種類

上市股份 (包括交易所買賣基金及上市房地產投資信託基金，但不包括債務證券)

債務證券

投資基金 (不包括交易所買賣基金及上市房地產投資信託基金)

其他

列入 1022 單元格內的數額

| 市值 (HK\$'000) | |
|-----------------|-----------|
| 上市股份 | 0 [1111A] |
| 債務證券 | 0 [1111B] |
| 投資基金 | 0 [1111C] |
| 其他 | 0 [1111D] |
| 列入 1022 單元格內的數額 | 0 [1111E] |

(B) 請列出市值佔 1105 單元格中所申報的流動資金盈餘超過 10% 的證券、虛擬資產及指明投資項目的個別自營交易持倉 (按市值由高至低排列)(請提供最多 50 項投資)

附註：就虛擬資產的自營交易持倉而言，請在“股份代號 / sedol 號碼 / ISIN 編碼”一欄中輸入“VA”。

| 行 | 序 | 產品名稱 | 產品性質 | 股份代號 / sedol 號碼 / ISIN 編碼 | 市值 (HK\$'000) | 行 |
|------|---|------|------|---------------------------|---------------|------|
| [6] | 1 | | | | 0 | [6] |
| [7] | 2 | | | | 0 | [7] |
| [8] | 3 | | | | 0 | [8] |
| [9] | 4 | | | | 0 | [9] |
| [10] | 5 | | | | 0 | [10] |

增加額外行數

移除額外行數

附註 7：與期貨合約及非上市期權合約有關的認可負債分析

公司帳戶

客戶帳戶 (即保證金短欠數額)

| (HK\$'000) | |
|------------|-----------|
| 公司帳戶 | 0 [1112A] |
| 客戶帳戶 | 0 [1112B] |

附註 8：股東資金分析

條次

繳足股本

留存利潤/累積虧損

其他儲備

列入 1106 單元格內的數額

| (HK\$'000) | |
|-----------------|----------|
| 繳足股本 | 0 [1113] |
| 留存利潤/累積虧損 | 0 [1114] |
| 其他儲備 | 0 [1115] |
| 列入 1106 單元格內的數額 | 0 [1116] |

本人證明以下記項、申報表、分析或報告所載的資料，盡我所知及所信是真確無訛的。此外，本人亦確認，凡本人留空任何記項、申報表、分析或報告，即表明並無有關資料可供申報，或有關記項、申報表、分析或報告並不適用：

(請選擇適用者)

須按月呈交的表格：(附註1)

| | | | |
|-------|-------------------------------|--------------------------|---------|
| 表格 1 | 速動資金計算表 | <input type="checkbox"/> | [1117] |
| 表格 2 | 規定速動資金計算表 | <input type="checkbox"/> | [1118] |
| 表格 3 | 信貸融通摘要 | <input type="checkbox"/> | [1119] |
| 表格 4 | 保證金客戶分析 | <input type="checkbox"/> | [1120] |
| 表格 5 | 證券抵押品分析 | <input type="checkbox"/> | [1121] |
| 表格 6 | 滾存結餘現金客戶分析 | <input type="checkbox"/> | [1122] |
| 表格 7 | 損益表 | <input type="checkbox"/> | [1123] |
| 表格 8 | 客戶資產分析 | <input type="checkbox"/> | [1124] |
| 表格 8A | 相關集體投資計劃財產分析 | <input type="checkbox"/> | [1124A] |
| 表格 9 | 就槓桿式外匯交易獲發牌的持牌法團的 外幣持倉量的狀況 | <input type="checkbox"/> | [1125] |

須按每季基準並連同就 3 月、6 月、9 月及 12 月
呈交的每月財務申報表呈交的表格：(附註1)

| | | | |
|-------|--------------|--------------------------|--------|
| 表格 10 | 衍生工具自營交易持倉報告 | <input type="checkbox"/> | [1126] |
| 表格 11 | 認可對手方名單 | <input type="checkbox"/> | [1127] |
| 表格 12 | 客戶群及所管理的資產 | <input type="checkbox"/> | [1128] |

以電子形式簽署申報表的人的姓名 (附註2)：

[1130]

身分*：

[1131]

日期 (dd/mmm/yyyy 例如：01/Jan/2009)：

[1132]

* 請選擇適用者

附註 1：凡持牌法團就以下一類或多於一類受規管活動獲發牌：就證券提供意見、就期貨合約提供意見、就機構融資提供意見、提供資產管理及 / 或提供信貸評級服務，及凡該法團受指明發牌條件規限，該法團應按半年期的基準呈交表格 1、2、7 及 12。

附註 2：填寫以《證券及期貨(財政資源)規則》第56(6)條所規定的電子形式簽署申報表的人的姓名。

規定速動資金計算表
申報月份終結時的狀況

[1004]

| | | 條次 | (HK\$'000) |
|-------|---|----------|------------|
| (I) | 最低規定金額：HK\$100,000、HK\$500,000、 HK\$3,000,000 或 HK\$15,000,000 (A) | 附表 1 表 2 | [2000] 0 |
| (II) | 可變動規定速動資金 | 2 | (HK\$'000) |
| | 資產負債表上的負債，包括為已有負債或為或有負債提撥的準備金額 (B) | | [2001] 0 |
| | 減去： | | |
| | 就以下項目而應向客戶支付的數額： | | |
| | - 按照《證券及期貨(客戶款項)規則》在獨立帳戶內持有的客戶款項 (C) | | [2002] 0 |
| | - 在認可財務機構及 / 或核准的在香港以外成立為法團的銀行的獨立帳戶內持有的其他客戶款項 (D) | | [2003] 0 |
| | - 在於期貨或期權結算所獨立帳戶內持有的客戶款項 (E) | | [2004] 0 |
| | - 由結算所 (期貨或期權結算所除外)、結算所參與者、期貨交易商或證券交易商持有作為保證金的客戶款項 (F) | | [2005] 0 |
| | 相關集體投資計劃的計劃款項及其他款項： | | |
| | - 由就第13類受規管活動獲發牌的持牌法團按照《證券及期貨(客戶款項)規則》於獨立帳戶內持有的計劃款項 (FA) | | [2005A] 0 |
| | - 由就第13類受規管活動獲發牌的持牌法團在認可財務機構及 / 或在香港以外的銀行的獨立帳戶內持有的其他計劃款項 (FB) | | [2005B] 0 |
| | - 由就第13類受規管活動獲發牌的持牌法團在獨立於該持牌法團本身的帳戶及在認可財務機構、在香港以外的銀行及 / 或在證監會根據《證券及期貨(客戶款項)規則》批准的人士處維持以指定用途持有有關款項的帳戶內持有的認購款項、贖回款項及分派款項款額 (FC) | | [2005C] 0 |
| | 核准後借貸款 (G) | | [2006] 0 |
| | 就持牌法團用作進行其獲發牌進行的受規管活動的任何處所而訂立的租賃協議所產生的負債數額，而該數額相等於該法團因該租賃協議所產生而未有根據《證券及期貨(財政資源)規則》第4部第3分部的任何條文列入其速動資產內的資產總值 (H) | | [2006A] 0 |
| | 經調整負債 (I) = (B) - (C) - (D) - (E) - (F) - (FA) - (FB) - (FC) - (G) - (H) | 2 | [2007] 0 |
| | 加上： | | |
| | 代客戶持有的未平倉期貨合約及未平倉非上市期權合約的規定開倉保證金及就該等未平倉合約按規定須存放的保證金數額的合計總額： | | |
| | (a) 在以下市場買賣的期貨合約及非上市期權合約 (股票期權合約除外)： | | |
| | - 香港期貨交易所有限公司 (J) | | [2008A] 0 |
| | - 其他市場 (K) | | [2008B] 0 |
| | (b) 在以下市場買賣的股票期權合約： | | |
| | - 香港聯合交易所有限公司 (L) | | [2008C] 0 |
| | - 其他市場 (M) | | [2008D] 0 |
| | 經調整負債及客戶保證金的合計總額 (N) = (I) + (J) + (K) + (L) + (M) | | [2009] 0 |
| | 基本數額 (O) = (N) x 5% | 2 | [2010] 0 |
| | 加上：就槓桿式外匯交易獲發牌的持牌法團的合計外幣總持倉量的 1.5% (P) | | [2011] 0 |
| | 可變動規定速動資金 (Q) = (O) + (P) | | [2012] 0 |
| (III) | 規定速動資金 (即 (A) 與 (Q) 中的較高者) | 2 | [2013] 0 |

| 行 | 信貸通組別 (附註 2) | 財務機構名稱 (附註 3) | | 信貸融通種類及限額 (附註 4) | | | 持牌法團已 提取或動用 的金額 (附註 1) | | 所提供保證的種類 (附註 5) | | 所提供保證 的市值 | | 所提供保證 的可接受 折扣值 (附註 6) | | 行 |
|------|-----------------|------------------|----|---------------------|-----------------------------|------------------|---------------------------------|------------|--------------------|----|-----------------------------|------------|--------------------------------|------------|------|
| | | 財務機構代號 | 名稱 | 性質 | 到期日或 屆滿日 (dd/mm/yyyy) | 限額 (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | 保證代號 | 種類 | 提供者的姓名或 名稱及其與持牌 法團的關係 | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | |
| [1] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [1] |
| [2] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [2] |
| [3] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [3] |
| [4] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [4] |
| [5] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [5] |
| [6] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [6] |
| [7] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [7] |
| [8] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [8] |
| [9] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [9] |
| [10] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [10] |
| [11] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [11] |
| [12] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [12] |
| [13] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [13] |
| [14] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [14] |
| [15] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [15] |
| [16] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [16] |
| [17] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [17] |
| [18] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [18] |
| [19] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [19] |
| [20] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [20] |
| [21] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [21] |
| [22] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [22] |
| [23] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [23] |
| [24] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [24] |
| [25] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [25] |
| [26] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [26] |
| [27] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [27] |
| [28] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [28] |
| [29] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [29] |
| [30] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [30] |
| [31] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [31] |
| [32] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [32] |
| [33] | | | | | | 0 | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | 0 | [33] |

| | | | | | | | | | | | | | |
|------|--|--|--|--|----|--------|---|--------|--|--------|---|--------|------|
| [34] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [34] |
| [35] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [35] |
| [36] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [36] |
| [37] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [37] |
| [38] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [38] |
| [39] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [39] |
| [40] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [40] |
| [41] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [41] |
| [42] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [42] |
| [43] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [43] |
| [44] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [44] |
| [45] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [45] |
| [46] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [46] |
| [47] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [47] |
| [48] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [48] |
| [49] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [49] |
| [50] | | | | | | 0 | 0 | | | | 0 | 0 | [50] |
| | | | | | 總額 | [3000] | 0 | [3001] | | [3002] | 0 | [3003] | |

附註 1： (a) 該持牌法團以保證金客戶提供的抵押品作為全部或部分保證而已提取或動用的貸款總額：

HK\$ ('000) [3004]

(b) 經再質押的保證金客戶證券的總市值

HK\$ ('000) [3005]

(c) 在本表格內申報的來自認可財務機構或其他財務機構的貸款及透支總額，應分別相等於表格 1 的資產負債表內的 1076 或 1078 單元格內的數額。

附註 2： 請為每項信貸融通按照以下準則編配一個順序遞增的組別號碼 (即凡屬第 1 組者，即填上“1”字，屬第 2 組者，填上“2”字，如此類推)：

- (a) 每項信貸融通應分行填報，並獲編配一個獨立的組別號碼；
- (b) 如某項信貸融通以多於一類保證作為保證，每類該等保證應分行填報，而有關的行政應獲編配同一組別號碼；
- (c) 如某類保證被用作多於一項信貸融通的保證，每項該等融通應分行填報，而有關的行政應獲編配同一組別號碼；及 / 或
- (d) 如某組信貸融通以不同種類的保證作為保證，請將該組的每項信貸融通及每類保證分行填報，而有關的行政應獲編配同一組別號碼。

附註 3： (a) 就本表格而言，財務機構包括認可財務機構及其他財務機構 (如：持牌法團、持牌提供者、海外銀行及海外證券交易商)。

(b) 持牌法團應從電腦屏幕上提供的選單 (pull-down menu) 中選取財務機構代號。如該選單中並無所需的財務機構名稱，請從“901”、“902”或“920”中選取適用的財務機構代號，並在所提供的空位內註明有關財務機構的名稱。

附註 4： 持牌法團應從電腦屏幕上提供的選單 (pull-down menu) 中選取信貸融通代號。如該選單中並無所需的信貸融通性質，請從“99a”或“99b”中選取適用的信貸融通代號，並在所提供的空位內註明有關信貸融通的性質。

附註 5： 持牌法團應從電腦屏幕上提供的選單 (pull-down menu) 中選取保證代號。如該選單中並無所需的保證種類，請選用保證代號“99”，並在所提供的空位內註明有關保證的種類。

附註 6： 即有關財務機構準備按照所提供的保證授予的信貸融通總額。

表格 4 保證金客戶分析

表 1 按申報月份終結時的未經調整貸款結餘作出的分析

[1004]

(附註 1)

前列保證金客戶(按申報月份終結時的未經調整貸款結餘由高至低排列) (附註 2)

| 行 | 客戶姓名或名稱 | 名次 | 未經調整 貸款結餘 (HK\$'000) (A) | 抵押品 市值 (HK\$'000) (B) | 經調整 貸款結餘 (附註 1) (HK\$'000) | 貸款與 抵押品比率 (%) (C)=(A)/(B) | 首 3 位抵押品 (附註 3) | | | | | | | | | 行 |
|------|---------|----|-----------------------------------|--------------------------------|-------------------------------------|------------------------------------|-----------------|------------------------------------|------------------|-------|------------------------------------|------------------|-------|------------------------------------|------------------|------|
| | | | | | | | 抵押品 1 | | | 抵押品 2 | | | 抵押品 3 | | | |
| | | | | | | | 名稱 | 股份代號 / sedol 號碼 / ISIN 編碼 | 市值 (HK\$'000) | 名稱 | 股份代號 / sedol 號碼 / ISIN 編碼 | 市值 (HK\$'000) | 名稱 | 股份代號 / sedol 號碼 / ISIN 編碼 | 市值 (HK\$'000) | |
| [1] | | 1 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [1] |
| [2] | | 2 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [2] |
| [3] | | 3 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [3] |
| [4] | | 4 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [4] |
| [5] | | 5 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [5] |
| [6] | | 6 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [6] |
| [7] | | 7 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [7] |
| [8] | | 8 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [8] |
| [9] | | 9 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [9] |
| [10] | | 10 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [10] |
| [11] | | 11 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [11] |
| [12] | | 12 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [12] |
| [13] | | 13 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [13] |
| [14] | | 14 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [14] |
| [15] | | 15 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [15] |
| [16] | | 16 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [16] |
| [17] | | 17 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [17] |
| [18] | | 18 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [18] |
| [19] | | 19 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [19] |
| [20] | | 20 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [20] |
| [21] | | 21 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [21] |
| [22] | | 22 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [22] |
| [23] | | 23 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [23] |
| [24] | | 24 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [24] |
| [25] | | 25 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [25] |
| [26] | | 26 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [26] |
| [27] | | 27 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [27] |
| [28] | | 28 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [28] |
| [29] | | 29 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [29] |
| [30] | | 30 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [30] |
| [31] | | 31 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [31] |
| [32] | | 32 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [32] |
| [33] | | 33 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [33] |
| [34] | | 34 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [34] |
| [35] | | 35 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [35] |
| [36] | | 36 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [36] |
| [37] | | 37 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [37] |
| [38] | | 38 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [38] |
| [39] | | 39 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | | 0 | | | 0 | [39] |

| | | | | | | | | | | | | | | |
|--|----|--------|---|---|------|--------|--|---|--|---|--|--|---|------|
| [40] | 40 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [40] |
| [41] | 41 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [41] |
| [42] | 42 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [42] |
| [43] | 43 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [43] |
| [44] | 44 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [44] |
| [45] | 45 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [45] |
| [46] | 46 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [46] |
| [47] | 47 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [47] |
| [48] | 48 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [48] |
| [49] | 49 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [49] |
| [50] | 50 | 0 | 0 | 0 | 0.00 | | | 0 | | 0 | | | 0 | [50] |
| 小計(附註 2) | | [4000] | 0 | 0 | 0 | [4002] | | | | | | | | |
| 其他借款保證金客戶 | | [4003] | 0 | 0 | 0 | [4005] | | | | | | | | |
| 減去：就所有保證金客戶 提撥的壞帳或呆帳 一般準備金(如有的 話)(附註 4) | | [4006] | 0 | | 0 | [4007] | | | | | | | | |
| 扣除壞帳或呆帳一般準備 金(如有的話)後的貸款 結餘總額(附註 4) | | [4008] | 0 | 0 | 0 | [4010] | | | | | | | | |

附註 1：未經調整貸款結餘指應從每名保證金客戶收取的貸款結餘扣除壞帳或呆帳特定準備金後所得的數額。經調整貸款結餘即在扣除就保證金客戶的集中作出的調整之前，可列入速動資產內的貸款結餘的數額。

附註 2：如未經調整貸款結餘總額超過HK\$1,000,000,000，請提供前50名保證金客戶的資料。否則，請提供前20名保證金客戶的資料。

附註 3：如屬在認可證券市場上市的證券，請填上其股份代號；如屬其他證券，請填上 sedol 號碼或 ISIN 編碼。

附註 4：(i) 請注意，鑑於在 4002 及 4005 單元格內所申報的數額的合計總額代表保證金貸款應收款項的經調整結餘總額，而該經調整結餘總額將會列入作為速動資產，因此，4007 單元格內的壞帳或呆帳一般準備金一項一般不會申報任何數額。然而，根據《證券及期貨(財政資源)規則》第 22(3) 條，如果在 4002 及 4005 單元格內申報的數額的合計總額，超出將保證金貸款應收款項總額減去壞帳或呆帳特定及一般準備金的合計總額後所得的數額(即 4008 單元格)，則可能需要在 4007 單元格內提供一個結平數額，讓列入作為速動資產的經調整貸款結餘總額(即 4010 單元格)，相等於將保證金貸款應收款項總額減去壞帳或呆帳特定及一般準備金(如有的話)合計總額後所得的數額(即 4008 單元格)。

在扣除壞帳或呆帳一般準備金後的未經調整貸款結餘總額及經調整貸款結餘總額，應分別相等於在 1012 及 1011 單元格內申報的數額。

(ii) 如所有保證金客戶的未清償的追繳保證金額合計超出1106單元格內申報的股東資金的25%，請提供以下按申報月份終結時的未清償的追繳保證金的帳齡的分析：

| 未清償的追繳保證金的帳齡 | 未清償的追繳保證金額 (HK\$'000) | |
|--------------|--------------------------|--------|
| 90 日內 | 0 | [4011] |
| 超過 90 日 | 0 | [4012] |
| 總額 | 0 | [4013] |

就本表格而言，如保證金客戶在申報月份終結時尚有未清償的追繳保證金額，追繳保證金的帳齡便應由帳戶內有未清償的追繳保證金額的第一日起計。

表格 4 保證金客戶分析

表 2 按申報月份終結時的經調整貸款結餘作出的分析

[1004]

在申報月份終結時經調整貸款結餘超出經調整貸款結餘總額 10% 的保證金客戶

| 行 | 組別號碼 (附註 1) | 客戶姓名或名稱 (附註 2) | 經調整貸款結餘 (HK\$'000) | 行 |
|------|----------------|----------------|-----------------------|--------|
| [1] | | | 0 | [1] |
| [2] | | | 0 | [2] |
| [3] | | | 0 | [3] |
| [4] | | | 0 | [4] |
| [5] | | | 0 | [5] |
| [6] | | | 0 | [6] |
| [7] | | | 0 | [7] |
| [8] | | | 0 | [8] |
| [9] | | | 0 | [9] |
| [10] | | | 0 | [10] |
| [11] | | | 0 | [11] |
| [12] | | | 0 | [12] |
| [13] | | | 0 | [13] |
| [14] | | | 0 | [14] |
| [15] | | | 0 | [15] |
| [16] | | | 0 | [16] |
| [17] | | | 0 | [17] |
| [18] | | | 0 | [18] |
| [19] | | | 0 | [19] |
| [20] | | | 0 | [20] |
| [21] | | | 0 | [21] |
| [22] | | | 0 | [22] |
| [23] | | | 0 | [23] |
| [24] | | | 0 | [24] |
| [25] | | | 0 | [25] |
| [26] | | | 0 | [26] |
| [27] | | | 0 | [27] |
| [28] | | | 0 | [28] |
| [29] | | | 0 | [29] |
| [30] | | | 0 | [30] |
| | 總額 | | 0 | [4100] |

附註 1： 須將關連保證金客戶 (如有的話) 分組。請為每一組關連保證金客戶編配一個順序遞增的組別號碼。即凡屬第 1 組者，即填上“1”字。屬第 2 組者，填上“2”字。如此類推。

附註 2： 凡一組關連保證金客戶的經調整貸款結餘總額超出所有保證金客戶的經調整貸款結餘總額的 10%，須提供該組關連保證金客戶內的每名關連客戶的姓名或名稱。

表格 5 證券抵押品分析
申報月份終結時的狀況

[1004]

| 行 | 名稱 | 股份代號 / sedol 號碼 / ISIN 編碼 (附註 2) | 市值 (HK\$'000) (附註 3) | 行 |
|------|--------------------------------|---|----------------------------|--------|
| | 須採用 80% 非速動抵押品扣減率的證券抵押品 (附註 1) | | | |
| [1] | | | 0 | [1] |
| [2] | | | 0 | [2] |
| [3] | | | 0 | [3] |
| [4] | | | 0 | [4] |
| [5] | | | 0 | [5] |
| [6] | | | 0 | [6] |
| [7] | | | 0 | [7] |
| [8] | | | 0 | [8] |
| [9] | | | 0 | [9] |
| [10] | | | 0 | [10] |
| [11] | | | 0 | [11] |
| [12] | | | 0 | [12] |
| [13] | | | 0 | [13] |
| [14] | | | 0 | [14] |
| [15] | | | 0 | [15] |
| [16] | | | 0 | [16] |
| [17] | | | 0 | [17] |
| [18] | | | 0 | [18] |
| [19] | | | 0 | [19] |
| [20] | | | 0 | [20] |
| [21] | | | 0 | [21] |
| [22] | | | 0 | [22] |
| [23] | | | 0 | [23] |
| [24] | | | 0 | [24] |
| [25] | | | 0 | [25] |
| [26] | | | 0 | [26] |
| [27] | | | 0 | [27] |
| [28] | | | 0 | [28] |
| [29] | | | 0 | [29] |
| [30] | | | 0 | [30] |
| [31] | | | 0 | [31] |
| [32] | | | 0 | [32] |
| [33] | | | 0 | [33] |
| [34] | | | 0 | [34] |
| [35] | | | 0 | [35] |
| [36] | | | 0 | [36] |
| [37] | | | 0 | [37] |
| [38] | | | 0 | [38] |
| [39] | | | 0 | [39] |
| [40] | | | 0 | [40] |
| [41] | | | 0 | [41] |
| [42] | | | 0 | [42] |
| [43] | | | 0 | [43] |
| [44] | | | 0 | [44] |
| [45] | | | 0 | [45] |
| [46] | | | 0 | [46] |
| [47] | | | 0 | [47] |
| [48] | | | 0 | [48] |
| [49] | | | 0 | [49] |
| [50] | | | 0 | [50] |
| [51] | | | 0 | [51] |
| [52] | | | 0 | [52] |
| [53] | | | 0 | [53] |
| [54] | | | 0 | [54] |
| [55] | | | 0 | [55] |
| [56] | | | 0 | [56] |
| [57] | | | 0 | [57] |
| [58] | | | 0 | [58] |
| [59] | | | 0 | [59] |
| [60] | | | 0 | [60] |
| | 總數 | | 0 | [5003] |

附註 1：自市值最高的證券開始順序排列。

附註 2：如屬在認可證券市場上市的證券，請填上其股份代號；如屬其他證券，請填上 sedol 號碼或 ISIN 編碼。

附註 3：應將所有保證金客戶(不論其有否貸款)的證券抵押品列入本分析內。

附註 1： 帳戶結餘代表應從每名滾存結餘現金客戶收取的款項淨額扣除任何壞帳或呆帳特定準備金後所得的數額。

附註 2： 經調整結餘即可列入速動資產內的數額。

附註 3： 如屬在認可證券市場上市的證券，請填上其股份代號；如屬其他證券，請填上 sedol 號碼或 ISIN 編碼。

附註 4： 請注意，鑑於在 6002 及 6005 單元格內所申報的數額的合計總額代表應從滾存結餘現金客戶收取的款項的經調整結餘總額，而該經調整結餘總額將會列入作為速動資產，因此，6007 單元格內的壞帳或呆帳一般準備金一項一般不會申報任何數額。然而，根據《證券及期貨(財政資源)規則》第 21(7) 條，如果在 6002 及 6005 單元格內申報的數額的合計總額，超出將應從滾存結餘現金客戶收取的款項總額減去壞帳或呆帳特定及一般準備金的合計總額後所得的數額 (即 6008 單元格)，則可能需要在 6007 單元格內提供一個結平數額，讓列入作為速動資產的經調整結餘總額 (即 6010 單元格)，相等於將應從滾存結餘現金客戶收取的款項總額減去壞帳或呆帳特定及一般準備金 (如有的話) 合計總額後所得的數額 (即 6008 單元格)。

在扣除壞帳或呆帳一般準備金後的帳戶結餘總額及經調整結餘總額，應分別相等於在 1016 及 1015 單元格內申報的數額。

| | 本月 | 上月 | 自上一財政年度終結時起計，由年度初至今 |
|--------------------------------------|------------|------------|---------------------|
| 成交量 | | | |
| 證券交易 (股票期權合約交易除外) (附註 1) (交易總額) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) |
| - 本身帳戶 | 0 [7000] | 0 [7001] | 0 [7002] |
| - 客戶帳戶 | 0 [7003] | 0 [7004] | 0 [7005] |
| | 0 [7006] | 0 [7007] | 0 [7008] |
| 期貨交易及期權交易 (包括股票期權合約) (附註 1b) | 合約數量 | 合約數量 | 合約數量 |
| - 本身帳戶 | 0 [7009] | 0 [7010] | 0 [7011] |
| - 客戶帳戶 | 0 [7012] | 0 [7013] | 0 [7014] |
| | 0 [7015] | 0 [7016] | 0 [7017] |
| 槓桿式外匯交易 (附註 1a 及 2) (合約本金總額的合計總額) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) |
| | 0 [7018A] | 0 [7019A] | 0 [7020A] |
| 虛擬資產交易 | | | |
| - 本身帳戶 | 0 [7020B] | 0 [7020C] | 0 [7020D] |
| - 客戶帳戶 | 0 [7020E] | 0 [7020F] | 0 [7020G] |
| | 0 [7020H] | 0 [7020I] | 0 [7020J] |
| 損益表 | | | |
| 證券交易 (附註 1b) : | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) |
| 佣金收入 | 0 [7021] | 0 [7022] | 0 [7023] |
| 減去：佣金支出 (附註 3) | 0 [7024] | 0 [7025] | 0 [7026] |
| 小計 (A) | 0 [7027] | 0 [7028] | 0 [7029] |
| 期貨交易及期權交易 (附註 1b) : | | | |
| 佣金收入 | 0 [7030] | 0 [7031] | 0 [7032] |
| 減去：佣金支出 (附註 3) | 0 [7033] | 0 [7034] | 0 [7035] |
| 小計 (B) | 0 [7036] | 0 [7037] | 0 [7038] |
| 槓桿式外匯交易： | | | |
| 佣金收入 | 0 [7039] | 0 [7040] | 0 [7041] |
| 減去：佣金支出 (附註 3) | 0 [7042] | 0 [7043] | 0 [7044] |
| 小計 (C) | 0 [7045] | 0 [7046] | 0 [7047] |
| 虛擬資產交易 | | | |
| 佣金收入 | 0 [7047A] | 0 [7047B] | 0 [7047C] |
| 減去：佣金支出 (附註 3) | 0 [7047D] | 0 [7047E] | 0 [7047F] |
| 小計 (CA) | 0 [7047G] | 0 [7047H] | 0 [7047I] |
| 交易利潤及虧損 | | | |
| - 證券 (附註 1b) | 0 [7048] | 0 [7049] | 0 [7050] |
| - 期貨合約及期權合約 (附註 1b) | 0 [7051] | 0 [7052] | 0 [7053] |
| - 槓桿式外匯交易 | 0 [7054] | 0 [7055] | 0 [7056] |
| - 其他外匯交易 | 0 [7057] | 0 [7058] | 0 [7059] |
| - 場外衍生工具交易 | 0 [7060] | 0 [7061] | 0 [7062] |
| - 虛擬資產 (附註 1b) | 0 [7062A] | 0 [7062B] | 0 [7062C] |
| - 其他 (如屬關鍵項目，請註明) (附註 4) | 0 [7063] | 0 [7064] | 0 [7065] |
| [7063A] | | | |
| 小計 (D) | 0 [7066] | 0 [7067] | 0 [7068] |
| 因下列項目產生的收入： | | | |
| - 包銷及配售證券 | 0 [7069] | 0 [7070] | 0 [7071] |
| - 就證券及/或期貨合約提供意見 | 0 [7072] | 0 [7073] | 0 [7074] |
| - 就機構融資提供意見 | 0 [7075] | 0 [7076] | 0 [7077] |

| | | | | | | |
|---------------------------|---|---------|---|---------|---|---------|
| - 提供自動化交易服務 | 0 | [7078] | 0 | [7079] | 0 | [7080] |
| - 提供資產管理服務 | 0 | [7081] | 0 | [7082] | 0 | [7083] |
| - 向集團公司收取的管理費 (附註 5) | 0 | [7084] | 0 | [7085] | 0 | [7086] |
| - 提供信貸評級服務 | 0 | [7086A] | 0 | [7086B] | 0 | [7086C] |
| - 證券借貸及回購交易 (不包括利息收入) | 0 | [7086D] | 0 | [7086E] | 0 | [7086F] |
| - 為相關集體投資計劃提供存管服務 | 0 | [7086G] | 0 | [7086H] | 0 | [7086I] |
| - 其他 (如屬關鍵項目, 請註明) (附註 4) | 0 | [7087] | 0 | [7088] | 0 | [7089] |

[7087A]

小計 (E) 0 [7090] 0 [7091] 0 [7092]

收入總額 (F) = (A) + (B) + (C) + (CA) + (D) + (E) 0 [7093] 0 [7094] 0 [7095]

利息收入 / 支出

利息收入 (附註 6) 0 [7096] 0 [7097] 0 [7098]

減去: 利息支出 (附註 6) 0 [7099] 0 [7100] 0 [7101]

小計 (G) 0 [7102] 0 [7103] 0 [7104]

開支

- 薪金及員工福利 0 [7105] 0 [7106] 0 [7107]

- 辦公室租金及公用設施 0 [7108] 0 [7109] 0 [7110]

- 折舊 0 [7111] 0 [7112] 0 [7113]

- 法律及專業服務開支 0 [7114] 0 [7115] 0 [7116]

- 壞帳及呆帳準備金 0 [7117] 0 [7118] 0 [7119]

- 集團公司支取的管理費 (附註 7) 0 [7120] 0 [7121] 0 [7122]

- 其他 (如屬關鍵項目, 請註明) (附註 4) 0 [7123] 0 [7124] 0 [7125]

[7123A]

小計 (H) 0 [7126] 0 [7127] 0 [7128]

稅前盈利 / (虧損) 淨額 (I) = (F) + (G) - (H) 0 [7129] 0 [7130] 0 [7131]

減去: 稅項 (J) 0 [7132] 0 [7133] 0 [7134]

稅後盈利 / (虧損) 淨額 (K) = (I) - (J) 0 [7135] 0 [7136] 0 [7137]

期初留存利潤 / (累積虧損) (L) 0 [7138] 0 [7139] 0 [7140]

減去: 期內宣布分派的股息 (M) 0 [7141] 0 [7142] 0 [7143]

期終留存利潤 / (累積虧損)
(N) = (K) + (L) - (M) (附註 8) 0 [7144] 0 [7145] 0 [7146]

附註 1: (a) 非以港幣計值的交易, 應按有關月份終結時的當時匯率折算為港幣計值。

(b) 就本表格而言,

- “證券交易”及“證券交易利潤及虧損”並不包括股票期權合約的交易;

- “期貨交易及期權交易”及“期貨合約及期權合約交易利潤及虧損”包括股票期權合約的交易; 及

- 請將適用會計準則要求於損益表中反映的與虛擬資產價值相關的利潤或虧損 (例如: 低於成本的虛擬資產價值的變動) 包括在“交易利潤及虧損 - 虛擬資產”內。

附註 2: (a) 有關槓桿式外匯交易合約的本金總額的計算方法, 請參閱《證券及期貨(財政資源)規則》第41(3)條。

(b) 槓桿式外匯交易合約的本金總額的合計總額包括在有關月份內為開立槓桿式外匯合約及/或將槓桿式外匯合約平倉的合約的本金總額。

附註 3: 佣金支出包括支付予客戶主任或其他各方的佣金。

附註 4: 就本表格而言, 超出7093單元格內申報的收入總額的 30% 的任何收入項目, 或超出7126單元格內申報的開支總額的 30% 的任何開支項目, 應一概視為關鍵項目。

附註 5: 因下列項目產生的向集團公司收取的管理費

- 攤分交易利潤

- 收取開支

- 其他 (如該項目超出7093單元格內申報的收入總額的 30%, 請註明)

(HK\$'000)

0 [7146A]

0 [7146B]

0 [7146C]

[7146D]

列入 7084 單元格內的數額

0 [7146E]

附註 6：如利息收入總額超出7093單元格內申報的收入總額的 30%·或利息支出總額超出7126單元格內申報的開支總額的 30%·請提供有關利息收入及 / 或利息支出的詳情：

因下列項目而產生的利息收入

- 證券交易 (附註 1b)
- 期貨交易及期權交易 (附註 1b)
- 槓桿式外匯交易
- 證券保證金融資
- 銀行存款
- 證券借貸及回購交易
- 虛擬資產
- 其他 (如該項目超出7093單元格內申報的收入總額的 30%·請註明)

| | |
|--|---------|
| | [7152A] |
|--|---------|

(HK\$'000)

| | |
|---|---------|
| 0 | [7147] |
| 0 | [7148] |
| 0 | [7149] |
| 0 | [7150] |
| 0 | [7151] |
| 0 | [7151A] |
| 0 | [7151B] |
| 0 | [7152] |

列入 7096 單元格內的數額

| | |
|---|--------|
| 0 | [7153] |
|---|--------|

向以下各方 / 因下列項目支付或應支付的利息支出

- 客戶
- 銀行貸款及透支
- 證券借貸及回購交易
- 其他 (如該項目超出7126單元格內申報的開支總額的 30%·請註明)

| | |
|--|---------|
| | [7156A] |
|--|---------|

| | |
|---|---------|
| 0 | [7154] |
| 0 | [7155] |
| 0 | [7155A] |
| 0 | [7156] |

列入 7099 單元格內的數額

| | |
|---|--------|
| 0 | [7157] |
|---|--------|

附註 7：因下列項目產生的集團公司支取的管理費

- 攤分交易虧損
- 收取開支
- 其他 (如該項目超出7126單元格內申報的開支總額的 30%·請註明)

| | |
|--|---------|
| | [7160A] |
|--|---------|

(HK\$'000)

| | |
|---|--------|
| 0 | [7158] |
| 0 | [7159] |
| 0 | [7160] |

列入 7120 單元格內的數額

| | |
|---|--------|
| 0 | [7161] |
|---|--------|

附註 8：本月終結時的留存利潤 / (累積虧損) 的數額 (即 7144 單元格) 應相等於表格 1 附註 8 的 1114 單元格內申報的數額。

表 1 按申報月份終結時客戶種類及證券所在處的客戶證券 / 客戶虛擬資產分析

[1004]

| | | 市值 (HK\$'000) | |
|--|----------------------|------------------|----------|
| 客戶證券按客戶種類作出的分析 (附註 1) | | | |
| 現金客戶 (A) | | 0 | [8000] |
| 保證金客戶 (B) | | 0 | [8001] |
| 期貨客戶及期權客戶 (C) | | 0 | [8002] |
| 槓桿式外匯交易客戶 (D) | | 0 | [8003] |
| 持牌法團就證券、期貨合約及 / 或機構融資向其提供意見的客戶 (E) (附註 2a) | | 0 | [8004A] |
| 持牌法團向其提供資產管理服務的客戶 (F) (附註 2b) | | 0 | [8004B] |
| 持牌法團向其提供自動化交易服務的客戶 (G) (附註 2c) | | 0 | [8005B] |
| 其他 (請註明) (H) (附註 2d) | | 0 | [8005C] |
| [8005A] <input type="text"/> | | | |
| 總值 (I) = (A) + (B) + (C) + (D) + (E) + (F) + (G) + (H) | | 0 | [8006] |
| 客戶虛擬資產 (包括構成證券的虛擬資產) (附註 1) | | 0 | [8006A] |
| 客戶證券按所在處作出的分析 | | | |
| 香港 | | | |
| 質押予認可財務機構 (J) | | 0 | [8007A] |
| 質押予獲發牌進行證券交易的中介人 (K) | | 0 | [8008A] |
| 存放於持牌法團在債務工具中央結算系統內持有的戶口 (KA) | | 0 | [8008B] |
| 存放於持牌法團在中央結算及交收系統內的戶口 | | | |
| - 股份結算戶口 (L) | | 0 | [8009] |
| - 為現金客戶指定的獨立股份戶口 (M) | | 0 | [8010] |
| 請註明有關分戶口的號碼: | <input type="text"/> | | |
| [8010A] | | 0 | [8011] |
| - 為保證金客戶指定的獨立股份戶口 (N) | | 0 | [8011] |
| 請註明有關分戶口的號碼: | <input type="text"/> | | |
| [8011A] | | 0 | [8012] |
| - 附寄結單服務的獨立股份戶口 (O) | | 0 | [8012] |
| - 其他戶口 (P) | | 0 | [8013] |
| 請註明分戶口的號碼及作用: | | | |
| 分戶口號碼 | 作用 | | |
| <input type="text"/> [8013A] | <input type="text"/> | | [8013B] |
| <input type="text"/> [8013C] | <input type="text"/> | | [8013D] |
| <input type="text"/> [8013E] | <input type="text"/> | | [8013F] |
| <input type="text"/> [8013G] | <input type="text"/> | | [8013H] |
| 在中央結算及交收系統內持有的帳戶內存放的客戶證券總值 (Q) = (L) + (M) + (N) + (O) + (P) | | 0 | [8014] |
| 存放於持牌法團在聯合交易所期權結算有限公司持有的戶口內 (R) | | 0 | [8015] |
| 由有聯繫實體持有 (S) | | 0 | [8017] |
| - 請註明該等有聯繫實體的名稱: | <input type="text"/> | | |
| [8017A] | | 0 | [8018] |
| 存放於持牌法團在認可財務機構持有的戶口內作穩妥保管 (T) | | 0 | [8018] |
| 存放於持牌法團在其他持牌法團持有的戶口內作穩妥保管 (U) | | 0 | [8019] |
| 在持牌法團辦事處內持有 (V) | | 0 | [8020] |
| 在其他所在處或為其他目的持有 (W) (附註 3) | | 0 | [8021A] |
| 在香港持有的客戶證券總值 (X) = (J) + (K) + (KA) + (Q) + (R) + (S) + (T) + (U) + (V) + (W) | | 0 | [8021B] |
| 按所在處作出的客戶虛擬資產分析 | | | |
| 由有聯繫實體 / 其他持牌提供者持有 (註 5) | | 0 | [8021BA] |
| - 請註明所有有聯繫實體 / 持牌提供者的名稱: | <input type="text"/> | | |
| [8021BB] | | | |
| 香港以外 | | | |
| 質押予海外銀行 (Y) | | 0 | [8007B] |
| 質押予海外證券交易商 (Z) | | 0 | [8008] |
| 存放於持牌法團在海外結算所持有的戶口內 (AA) | | 0 | [8021C] |
| 存放於持牌法團在海外銀行持有的戶口內作穩妥保管 (AB) | | 0 | [8021D] |
| 存放於持牌法團在海外證券或期貨交易商持有的戶口內作穩妥保管 (AC) | | 0 | [8021E] |
| 在其他所在處或為其他目的持有 (AD) (附註 3) | | 0 | [8021F] |
| 在香港以外持有的客戶證券總值 (AE) = (Y) + (Z) + (AA) + (AB) + (AC) + (AD) | | 0 | [8021G] |
| 客戶證券的總值 = (X) + (AE) (附註 4) | | 0 | [8022] |
| 附註 1: 客戶證券 / 虛擬資產按下列基準記帳: (請選擇適用者) | | | |
| <input type="text"/> | | | |
| 附註 2: (a) 不包括已在 8000、8001、8002 及 8003 單元格內申報的客戶證券。 (b) 不包括已在 8000、8001、8002、8003 及 8004A 單元格內申報的客戶證券。 (c) 不包括已在 8000、8001、8002、8003、8004A 及 8004B 單元格內申報的客戶證券。 (d) 不包括已在 8000、8001、8002、8003、8004A、8004B 及 8005B 單元格內申報的客戶證券。 | | | |

附註 3：就“在其他所在處或為其他目的持有”的客戶證券而言，持有該等客戶證券市值最高的首 3 個所在處

| 香港 | | | | | |
|-----|----|------------------------|----|-----------------------|------------|
| 行 | 次序 | 銀行 / 經紀 / 對手方 / 保管人的名稱 | 目的 | 所持有客戶證券的市值 (HK\$'000) | 行 |
| [1] | 1 | | | 0 | [8026] [1] |
| [2] | 2 | | | 0 | [8027] [2] |
| [3] | 3 | | | 0 | [8028] [3] |

| 香港以外 | | | | | |
|------|----|------------------------|-----|----|-----------------------|
| 行 | 次序 | 銀行 / 經紀 / 對手方 / 保管人的名稱 | 所在處 | 目的 | 所持有客戶證券的市值 (HK\$'000) |
| [4] | 1 | | | | 0 [8029] [4] |
| [5] | 2 | | | | 0 [8030] [5] |
| [6] | 3 | | | | 0 [8031] [6] |

附註 4：持有客戶證券市值最高的首 3 名聯屬對手方或聯屬保管人

| 香港 | | | | | |
|-----|----|------------------|----|-----------------------|------------|
| 行 | 次序 | 聯屬對手方 / 聯屬保管人的名稱 | 目的 | 所持有客戶證券的市值 (HK\$'000) | 行 |
| [7] | 1 | | | 0 | [8032] [7] |
| [8] | 2 | | | 0 | [8033] [8] |
| [9] | 3 | | | 0 | [8034] [9] |

| 香港以外 | | | | | |
|------|----|------------------|-----|----|-----------------------|
| 行 | 次序 | 聯屬對手方 / 聯屬保管人的名稱 | 所在處 | 目的 | 所持有客戶證券的市值 (HK\$'000) |
| [10] | 1 | | | | 0 [8035] [10] |
| [11] | 2 | | | | 0 [8036] [11] |
| [12] | 3 | | | | 0 [8037] [12] |

附註 5：由有聯繫實體 / 其他持牌提供者持有客戶虛擬資產市值最高的首 3 個所在處

| 香港以外 | | | | | |
|------|----|--------|-----|----|-------------------------|
| 行 | 次序 | 對手方的名稱 | 所在處 | 目的 | 所持有客戶虛擬資產的市值 (HK\$'000) |
| [13] | 1 | | | | 0 [8038] [13] |
| [14] | 2 | | | | 0 [8039] [14] |
| [15] | 3 | | | | 0 [8040] [15] |

表格 8 客戶資產分析

表 2 申報月份終結時的獨立存放的
客戶款項的分析

(附註：同時為持牌提供者的持牌法團須在本表格內申報其有聯繫實體所持有的獨立存款的客戶款項)

[1004]

| 應向客戶支付的款項及須獨立存放的客戶款項 | 認可負債的 計算 (HK\$'000) (附註 1) | 獨立存放的 客戶款項的分析 (HK\$'000) (附註 2) | 根據 《證券及期貨(客戶款 項)規則》須獨立存放 的客戶款項 |
|---|-------------------------------------|--|---|
| | 應向客戶支付的 款項 | | |
| 現金客戶 | [8100] 0 | 0 | [8101] |
| 保證金客戶 | [8102] 0 | 0 | [8103] |
| 期貨客戶及期權客戶 | [8104] 0 | 0 | [8105] |
| 槓桿式外匯交易客戶 | [8106] 0 | 0 | [8107] |
| 持牌法團就證券、期貨合約及/或機 構融資向其提供意見及/或向其提供 資產管理服務的客戶 | [8108] 0 | 0 | [8109] |
| 其他 (請註明) | | | |
| [8110A] [] | [8110] 0 | 0 | [8111] |
| 總額 (附註 3) | [8112] 0 | 0 | [8113] |
| 獨立存放的款項的分布 | | | |
| 在認可財務機構維持的獨立帳戶 內持有的款額 (附註 4) | [8114] 0 | 0 | [8115] |
| 在證監會根據《證券及期貨(客戶款項)規則》 批准的其他人士維持的獨立帳戶內持有的款 額 (附註 4) | [8116] 0 | 0 | [8117] |
| 在核准的在香港以外成立為法團的銀行 的獨立帳戶內持有的款額 (附註 5) | [8118] 0 | | |
| 在認可結算所維持的獨立帳戶內持有的款額 | [8119] 0 | | |
| 其他 (包括於獨立帳戶內並根據《證券及期貨(財政資源)規則》第 20(d) 條列入速動資產的款額 (於此申報為扣減額) 及就修改而產生的數額) (請註明) | [8120] 0 | 0 | [8121] |
| [8120A] [] | [8122] 0 | 0 | [8123] |
| 獨立存放款項的盈餘 / (不足之數) (8123 – 8113 單元格) (附註 6) | | | 0 [8124] |
| 應列入速動資金計算表中第 23 項的認可負債內的數額 (8112 – 8122 單元格) (附註 6 及 7) | [8125] 0 | | |

附註 1：認可負債的計算是用作計算須列入表格 1 的速動資金計算表第 23 項內的數額 (即 1057 單元格) (該數額不應少於零)。

附註 2：獨立存放的客戶款項的分析是用作按照《證券及期貨(客戶款項)規則》而須獨立存放的客戶款項總額與在獨立帳戶內持有的相應數額進行對帳。

就本分析而言，獨立帳戶是指符合《證券及期貨(財政資源)規則》第 2(1) 條中“獨立帳戶”的定義中的(a)段的帳戶。

附註 3：列入 8112 單元格內的應向客戶支付的款項總額，應相等於列入表格 1 的資產負債表的第 23 項內應向客戶支付的款項的數額 (即 1058 單元格)。

附註 4：(a) 本項目所指的獨立帳戶是指符合《證券及期貨(財政資源)規則》第 2(1) 條中“獨立帳戶”的定義中的(a)段的帳戶。

(b) 在獨立帳戶內持有最大筆客戶款項總額的首 5 家認可財務機構及證監會根據《證券及期貨(客戶款項)規則》批准的其他人士 (附註 4a)

| 行 | 次 序 | 認可財務機構 / 證監會根據《證券及期貨(客戶款項)規則》批准的其他人士的名稱 | 有關機構 / 人士是否持牌法團的 聯屬公司? | 客戶款項的數額 (HK\$'000) | 行 |
|-----|--------|---|---------------------------|-----------------------|-------------|
| [1] | 1 | | | 0 | [8125A] [1] |
| [2] | 2 | | | 0 | [8125B] [2] |
| [3] | 3 | | | 0 | [8125C] [3] |
| [4] | 4 | | | 0 | [8125D] [4] |
| [5] | 5 | | | 0 | [8125E] [5] |

附註 5 : (a) 本項目所指的獨立帳戶是指符合《證券及期貨(財政資源)規則》第 2(1) 條中“獨立帳戶”的定義中的(a)段或(b)段的帳戶。

(b) 在獨立帳戶內持有最大筆客戶款項總額的首 5 家核准的在香港以外成立為法團的銀行 (附註 5a)

| 次 序 | 核准銀行的名稱 | 所在處 | 有關銀行是否持牌法團的 聯屬公司? | 客戶款項的數額 (HK\$'000) | |
|--------|---------|-----|----------------------|-----------------------|--------------|
| [6] | 1 | | | 0 | [8125F] [6] |
| [7] | 2 | | | 0 | [8125G] [7] |
| [8] | 3 | | | 0 | [8125H] [8] |
| [9] | 4 | | | 0 | [8125I] [9] |
| [10] | 5 | | | 0 | [8125J] [10] |

附註 6 : 請於下方闡述導致下述情形的情況 :

- (a) 為計算認可負債的獨立存放的款項總額超出應向客戶支付的款項的總額 (即 8122 單元格 > 8112 單元格) ;
- (b) 在 8125 單元格計算出的認可負債與列入表格 1 第 23 項內的認可負債數額 (即 1057 單元格) 之間存在差異 ; 及 / 或
- (c) 獨立存放款項出現盈餘或不足之數。

[8126]

附註 7 : 持有最大筆客戶款項總額的首 5 個海外對手方 (核准的在香港以外成立為法團的銀行除外)

| 次 序 | 對手方的名稱 | 對手方的種類 | 所在處 | 有關對手方是否持牌法團的 聯屬公司? | 客戶款項的數額 (HK\$'000) | |
|--------|--------|--------|-----|-----------------------|-----------------------|-------------|
| [11] | 1 | | | | 0 | [8127] [11] |
| [12] | 2 | | | | 0 | [8128] [12] |
| [13] | 3 | | | | 0 | [8129] [13] |
| [14] | 4 | | | | 0 | [8130] [14] |
| [15] | 5 | | | | 0 | [8131] [15] |

表 1 申報月份終結時持牌法團因進行第13類受規管活動而就任何相關集體投資計劃收取或持有的相關集體投資計劃財產(計劃款項除外)的狀況的分析

[1004]

| | 市價 (HK\$'000) | |
|--|------------------|--------|
| 適用於所有相關集體投資計劃(房地產投資信託基金除外) | | |
| 計劃證券分析(附註1及2) | | |
| 在香港 | | |
| 存放於持牌法團在認可財務機構持有的戶口內作穩妥保管(A)(附註3) | 0 | [8201] |
| 存放於持牌法團在中央結算及交收系統內持有的戶口作穩妥保管(B) | 0 | [8202] |
| 存放於持牌法團在債務工具中央結算系統內持有的戶口作穩妥保管(C) | 0 | [8203] |
| 存放於持牌法團在其他持牌法團持有的戶口內作穩妥保管(D)(附註3) | 0 | [8204] |
| 由有聯繫實體持有·該等有聯繫實體為:(附註4) | | |
| - 認可財務機構(E) | 0 | [8205] |
| - 請註明該有聯繫實體的名稱: | | |
| <input type="text"/> [8205A] | | |
| - 其他持牌法團(F) | 0 | [8206] |
| - 請註明該有聯繫實體的名稱: | | |
| <input type="text"/> [8206A] | | |
| - 其他實體(G) | 0 | [8207] |
| - 請註明該有聯繫實體的名稱: | | |
| <input type="text"/> [8207A] | | |
| 由有聯繫實體持有的計劃證券總市價(H) = (E) + (F) + (G) | 0 | [8208] |
| 在持牌法團辦事處處內持有(I) | 0 | [8209] |
| 在其他所在處持有(請註明)(附註5)(J) | 0 | [8210] |
| <input type="text"/> [8210A] | | |
| 在香港持有的計劃證券總市價 (K) = (A) + (B) + (C) + (D) + (H) + (I) + (J) | 0 | [8211] |
| 在香港以外 | | |
| 存放於持牌法團在香港以外的銀行持有的戶口內作穩妥保管(L) | 0 | [8212] |
| 存放於持牌法團在海外結算所持有的戶口內作穩妥保管(M) | 0 | [8213] |
| 存放於持牌法團在中央證券寄存處持有的戶口內作穩妥保管(N) | 0 | [8214] |
| 存放於持牌法團在海外證券或期貨交易商持有的戶口內作穩妥保管(O) | 0 | [8215] |
| 在其他所在處持有(請註明)(附註5)(P) | 0 | [8216] |
| <input type="text"/> [8216A] | | |
| 在香港以外持有的計劃證券總市價 (Q) = (L) + (M) + (N) + (O) + (P) | 0 | [8217] |
| 就所有相關集體投資計劃(房地產投資信託基金除外)持有的計劃證券總市價(R) = (K) + (Q) | 0 | [8218] |
| 所有相關集體投資計劃財產(計劃款項及計劃證券除外)最新可獲得的市價 | | |
| 在香港持有(請註明該相關集體投資計劃財產的性質)(S) | 0 | [8219] |
| <input type="text"/> [8219A] | | |
| 在香港以外持有(請註明該相關集體投資計劃財產的性質)(T) | 0 | [8220] |
| <input type="text"/> [8220A] | | |
| 就所有相關集體投資計劃(房地產投資信託基金除外)持有的所有相關集體投資計劃財產(計劃款項及計劃證券除外) 最新可獲得的總市價(U) = (S) + (T) | 0 | [8221] |
| 適用於所有屬房地產投資信託基金的相關集體投資計劃 | | |
| 該等房地產投資信託基金總值(V)(附註6) | 0 | [8222] |
| 請註該等房地產投資信託基金的名稱 | | |
| <input type="text"/> [8222A] | | |
| 持有的相關集體投資計劃財產(計劃款項除外)的總市價(W) = (R) + (U) + (V) | 0 | [8223] |
| 附註1: 計劃證券指由持牌法團在進行第13類受規管活動的過程中收取或持有或由該持牌法團的任何有聯繫實體收取或持有·而且就相關集體投資計劃而言構成相關集體投資計劃財產的任何客戶證券。 | | |
| 附註2: 計劃證券分析分為“在香港”及“在香港以外”兩類·並按從事第13類受規管活動的持牌法團的直接訂約對手方的所在處來劃分。 | | |
| 若該直接訂約對手方: | | |
| 1) 受證監會或香港金融管理局(“金管局”)監管; | | |
| 2) 為債務工具中央結算系統;或 | | |
| 3) 為主要營業地點位於香港的不受規管的實體· | | |
| 該對手方持有的計劃證券的市價應於“在香港”類別下申報。 | | |
| 附註3: 這些直接訂約對手方不得為從事第13類受規管活動的持牌法團的有聯繫實體(定義見《證券及期貨條例》(第571章)附表1第1部)。 | | |
| 附註4: 就屬有聯繫實體的直接訂約對手方而言·有聯繫實體持有的計劃證券的市價應按照適用的類別·在欄位[8205]、[8206]及[8207]下申報·而該有聯繫實體的名稱應在相應的欄位[8205A]、[8206A]及[8207A]內填寫。 | | |
| 附註5: 其他所在處包括獲委任的非銀行保管人(例如為獨立第三方的非銀行全球保管人)·而它不能被歸類入其他類別·如果有多於兩個其他所在處·請在空位內提供款額明細。 | | |
| 附註6: 房地產投資信託基金截至申報日期止的市價總值。 | | |

表格 8A 相關集體投資計劃財產分析

表 2 申報月份終結時持牌法團因進行第13類受規管活動而就任何相關集體投資計劃收取或持有的計劃款項及該持牌法團持有的相關集體投資計劃的其他款項的狀況的分析

[1004]

| | (HK\$'000) |
|---|------------|
| 由持牌法團持有的相關集體投資計劃的計劃款項及其他款項 | |
| 由持牌法團持有的相關集體投資計劃的計劃款項款額 (A) | 0 [8301] |
| 由持牌法團持有的相關集體投資計劃的認購款項、贖回款項及分派款項款額 (B) | 0 [8302] |
| 由持牌法團持有的相關集體投資計劃的計劃款項及其他款項總額 (C) = (A) + (B) | 0 [8303] |
| 由持牌法團持有且獨立存放的相關集體投資計劃的計劃款項及其他款項 | |
| 在香港 | |
| 在認可財務機構維持的獨立帳戶及相關集體投資計劃帳戶(附註1)內持有的計劃款項款額 (D) | 0 [8304] |
| 在證監會根據《證券及期貨(客戶款項)規則》批准的人士處維持的獨立帳戶及相關集體投資計劃帳戶(附註1)內持有的計劃款項款額 (E) | 0 [8305] |
| 在獨立於持牌法團本身的帳戶及在認可財務機構維持以指定用作持有有關款項的銀行帳戶內持有的認購款項、贖回款項及分派款項款額 (F) | 0 [8306] |
| 在獨立於持牌法團本身的帳戶及在證監會根據《證券及期貨(客戶款項)規則》批准的人士處維持以指定用作持有有關款項的帳戶內持有的認購款項、贖回款項及分派款項款額 (G) | 0 [8307] |
| 在其他所在處持有(如有適用的修改，請註明) (H) (附註2) | |
| [8308A] | 0 [8308] |
| 小計 (I) = (D) + (E) + (F) + (G) + (H) | 0 [8309] |
| 在香港以外 | |
| 在香港以外的銀行維持的獨立帳戶內持有的計劃款項款額 (J) | 0 [8310] |
| 在獨立於持牌法團本身的帳戶及在香港以外的銀行維持以指定用作持有有關款項的銀行帳戶內持有的認購款項、贖回款項及分派款項款額 (K) | 0 [8311] |
| 在其他海外所在處持有(如有適用的修改，請註明) (L) (附註2) | |
| [8312A] | 0 [8312] |
| 小計 (M) = (J) + (K) + (L) | 0 [8313] |
| 獨立存放的相關集體投資計劃的計劃款項及其他款項總額 (N) = (I) + (M) | 0 [8314] |
| 應列入速動資金計算表中第 23A 項的認可負債內的數額 (O) = (C) - (N) | 0 [8315] |
| <p>附註1： 相關集體投資計劃帳戶指以開放式基金型公司的形式或任何其他公司形式組成的相關集體投資計劃的董事會按照《證券及期貨(客戶款項)規則》第10B(6)及(7)條以該相關集體投資計劃的名義開立和維持的，及就第13類受規管活動獲發牌的持牌法團在進行第13類受規管活動的過程中對其擁有控制權的或該持牌法團的有關聯繫實體對其擁有控制權的帳戶。</p> <p>附註2： 其他所在處包括獲委任的非銀行保管人(例如為獨立第三方的非銀行全球保管人)，而它不能被歸類入其他類別。如果有多於兩個其他所在處，請在空位內提供款項明細。</p> | |

表格 9 就槓桿式外匯交易獲發牌的持牌法團的外幣持倉量的狀況
申報月份終結時的狀況

[1004]

| 貨幣代號 | 貨幣 (附註 1) | | 外幣持倉量 (包括所持有的與認可對手方維持的持倉) | | | | | 與認可對手方的持倉 | | 合計外幣總持倉量 |
|------|------------|------------|---------------------------|--------------------------|-----------------------------|---------------|------------|--|--|-----------------------|
| | 種類 | 資產 | 負債 | 未平倉合約 (包括現貨合約) | | 外幣總持倉量 (附註 2) | 淨持倉量 | 資產及持牌法團根據未平倉合約 (包括現貨合約) 承擔該種外幣價值下跌風險的該種外幣的數額 | 負債及持牌法團根據未平倉合約 (包括現貨合約) 承擔該種外幣價值上升風險的該種外幣的數額 | (I) = (E) - (G) - (H) |
| | | | | 持牌法團承擔該種外幣價值下跌風險的該種外幣的數額 | 持牌法團承擔該種外幣價值上升風險的該種外幣的數額 | | | | | |
| (A) | (B) | (C) | (D) | (E) | (F) = (A) + (C) - (B) - (D) | (G) | (H) | (I) = (E) - (G) - (H) | | |
| | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | |
| [1] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [2] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [3] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [4] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [5] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [6] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [7] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [8] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [9] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [10] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [11] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [12] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [13] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [14] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [15] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [16] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [17] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [18] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [19] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| [20] | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 總額 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |

乘以 1.5%

列入規定速動資金計算表 2011 單元格內的數額

0

[9000]

附註 1：持牌法團應從電腦屏幕上提供的選單 (pull-down menu) 中選取貨幣代號。如該選單中並無所需的貨幣種類，請選取“099”這個貨幣代號，並在所提供的空位內註明有關貨幣的種類。

附註 2：有關“外幣總持倉量”一詞的定義，請參閱《證券及期貨(財政資源)規則》第 2A 條。而有關持牌法團與某客戶(在持牌法團開立的帳戶屬客戶匯集綜合帳戶的客戶除外)訂立的兩份成對的未平倉合約的處理，請參閱上述條文的第(3)款。

表 1 申報月份終結時的衍生工具合約名義
數額總額按相關風險作出的分析

[1004]

(HK\$'000)

| 名義數額總額 | 股本權益合約 (附註 3) | 息率合約 | 外匯合約 | 貴金屬合約 | 其他商品合約 | 虛擬資產 | 總額 |
|-----------|------------------|--------|--------|--------|--------|--------|----------------|
| 場外合約 | 行 | | | | | | 行 |
| 遠期 | [1] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [1] |
| 掉期 | [2] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [2] |
| 購買的期權 | [3] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [3] |
| 出售的期權 | [4] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [4] |
| 其他 (請註明) | [5] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [5] |
| [A100] | | | | | | | |
| 場外合約總額 | [6] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [6] |
| 場內合約 | | | | | | | |
| 期貨 – 好倉 | [7] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [7] |
| 期貨 – 淡倉 | [8] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [8] |
| 購買的非上市期權 | [9A] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [9A] |
| 購買的上市期權 | [9B] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [9B] |
| 出售的非上市期權 | [10A] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [10A] |
| 出售的上市期權 | [10B] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [10B] |
| 其他 (請註明) | [11] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [11] |
| [A101] | | | | | | | |
| 場內合約總額 | [12] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [12] |
| 場外及場內合約總額 | [13] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 [13] |
| | | [A102] | [A103] | [A104] | [A105] | [A106] | [A106A] [A107] |

附註 1：本表格應按每季基準呈報，即只需呈報 3 月、6 月、9 月及 12 月時的情況。



附註 2： 請根據每項概括性風險類別 (即股本權益、息率等) 在下方說明持牌法團的衍生工具自營交易活動。在該說明中，須至少提供涵蓋下列各項事宜的資料：

- (a) 每項交易持倉 / 組合背後的交易策略的性質、目標及運作 (例如，就股本證券而言，股本衍生工具的交易是否與套數有關，或與衍生權證或股本權益掉期的對沖有關；所使用的衍生工具的種類以及該等策略涉及的其他持倉的詳情)；
- (b) 源自衍生工具交易的主要收入及成本開支 (例如，交易利潤 / 虧損、佣金、收費等)；及
- (c) 有關衍生工具交易業務的未來計劃。

[A108]

附註 3： 就本表而言，在交易所上市的衍生權證屬交易所買賣的上市期權，而可轉換債券則屬場外股本衍生工具。股本權益合約包括股本權益指數合約。

表格 10 衍生工具自營交易持倉報告

表 2 申報月份終結時的衍生工具合約按市值及未實現價值作出的分析

[1004]

(HK\$'000)

| 市值 (附註 1) | | 股本權益合約 | 息率合約 | 外匯合約 | 貴金屬合約 | 其他商品合約 | 虛擬資產合約 | 總額 |
|------------------|--|--------|--------|--------|--------|--------|---------|--------|
| 場外合約 | | [A200] | [A201] | [A202] | [A203] | [A204] | [A204A] | [A205] |
| (a) 正市值總額 (附註 2) | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (b) 負市值總額 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | | [A206] | [A207] | [A208] | [A209] | [A210] | [A210A] | [A211] |
| 未實現價值 | | 股本權益合約 | 息率合約 | 外匯合約 | 貴金屬合約 | 其他商品合約 | 虛擬資產合約 | 總額 |
| 場內合約 | | [A212] | [A213] | [A214] | [A215] | [A216] | [A216A] | [A217] |
| (c) 未實現收益總額 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (d) 未實現虧損總額 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | | [A218] | [A219] | [A220] | [A221] | [A222] | [A222A] | [A223] |

附註 1：場外衍生工具合約的市值是指自願進行交易的各方在現行交易中 (強制出售或斬倉出售的情況除外) 可用以交換合約的款額。如無市場報價可供採用，則可採用持牌法團對市值的最佳估計，而該估計須以類似合約的市場報價或該法團的估值技術 (即公平價值) 為依據。

附註 2：正市值總額指如對手方違責將會導致持牌法團招致的損失，而該損失是根據以當時的市場價格或市場利率重新訂立合約的成本計算。例如，就場外遠期及掉期合約而言，正市值是指在估值日期計算的未實現收益。就場外期權合約的好倉而言，正市值是指該等期權的市場價格或公平價值 (這項計算並沒有把在法律上可強制執行的淨額結算安排下將會出現的任何信貸風險的減少計算在內)。

表格 10 衍生工具自營交易持倉報告

表 3 申報月份終結時的場外衍生工具合約
按距離到期日的餘下期間作出的分析

[1004]

(HK\$'000)

| 按場外合約計算的名義數額總額 (附註 1) | | 1 年或少於 1 年 | 1 年以上至 5 年 | 5 年以上 | 總額 | |
|--------------------------|-----|------------|------------|-------|----|------------|
| (a) 股本權益合約 | [1] | 0 | 0 | 0 | 0 | [A300] [1] |
| (b) 息率合約 | [2] | 0 | 0 | 0 | 0 | [A301] [2] |
| (c) 外匯合約 | [3] | 0 | 0 | 0 | 0 | [A302] [3] |
| (d) 貴金屬合約 | [4] | 0 | 0 | 0 | 0 | [A303] [4] |
| (e) 其他商品合約 | [5] | 0 | 0 | 0 | 0 | [A304] [5] |
| (f) 虛擬資產 | [6] | 0 | 0 | 0 | 0 | [A305] [6] |

附註 1： 本表內的資料按照有關衍生工具合約距離到期日的餘下期間分列。

表格 10 衍生工具自營交易持倉報告

表 4 申報月份終結時的場外衍生工具
合約按信貸質素作出的分析

[1004]

(HK\$'000)

| 對手方的 信貸質素 (附註 1) | 在計入抵押品及擔保前的風險 | | | | 在計入抵押品及擔保後的信 貸等值數額 | 行 |
|---------------------|---------------|--------------------|--------|--------|-----------------------|--------|
| | 正市值總額合計總數 | 現有信貸風險總額 (附註 2) | 抵押品總額 | 擔保合計總額 | | |
| 1 | [1] | 0 | 0 | 0 | 0 | [1] |
| 2 | [2] | 0 | 0 | 0 | 0 | [2] |
| 3 | [3] | 0 | 0 | 0 | 0 | [3] |
| 總額 | [4] | 0 | 0 | 0 | 0 | [4] |
| | | [A400] | [A401] | [A402] | [A403] | [A404] |

附註 1： 對手方的信貸質素類別界定如下：
 (a) 類別 1 用以識別現時仍獲標準普爾公司評定為 AA 級及以上或其他同等評級的對手方；
 (b) 類別 2 用以識別現時仍獲標準普爾公司評定為介乎 BBB 級及以上與 AA 級以下之間或其他同等評級的對手方；及
 (c) 類別 3 用以識別現時仍獲標準普爾公司評定為 BBB 級以下或其他同等評級或沒有獲得任何信貸評級的對手方。
 當根據有關評級進行上述的分類時，如沒有投資評級可供採用，則可採用持牌法團內部同等的信貸級別。

附註 2： 一份合約的現有信貸風險，是指如果根據在法律上可強制執行的雙邊淨額結算協議進行淨額計算後，該份合約的剩餘所得的市值。現有信貸風險應按下列方式計算：確定持牌法團與對手方之間是否已訂立在法律上可強制執行的雙邊淨額結算協議。如有此協議，該淨額結算協議涵蓋的與該對手方訂立的所有適用的合約的市值，須對銷至某單一數額。接著，須就所有其他市值為正數的合約確定其正市值總和。按以上所述，所有合約的現有信貸風險總額即 (i) 在法律上可強制執行的雙邊淨額結算協議所適用的合約的淨正市值，及 (ii) 所有其他合約的正市值總額的總和。

表格 10 衍生工具自營交易持倉報告

表 5 申報月份終結時已逾期的場外衍生工具
合約及信貸虧損的分析

[1004]

(HK\$'000)

| | | |
|--|---|--------|
| 已逾期達 30 至 89 日的衍生工具合約的正市值總額 | 0 | [A500] |
| 已逾期達 90 日或以上的衍生工具合約的正市值總額 (附註 1) | 0 | [A501] |
| 過去 1 個月的衍生工具合約的信貸虧損 (附註 2 及 3) | 0 | [A502] |
| <p>附註 1： 有關已逾期達 90 日或以上的衍生工具的資料應包括在技術上雖仍未逾期，但與預期不會根據有關的衍生工具合約支付欠下該持牌法團的所有款項的對手方所維持的衍生工具的資料。</p> <p>附註 2： 信貸虧損包括已作出的信貸撥備。</p> <p>附註 3： 請在下方描述持牌法團有關作出信貸撥備的政策。</p> | | |
| <div style="border: 1px solid black; height: 80px; width: 100%;"></div> | | [A503] |

衍生工具自營交易持倉報告

表 6 截至申報月份止的期間與衍生工具有關的交易利潤及虧損

[1004]

(HK\$'000)

| 與衍生工具有關的交易利潤及虧損 (附註 1) | | 股本權益合約 [A600] | 息率合約 [A601] | 外匯合約 [A602] | 貴金屬合約 [A603] | 其他商品合約 [A604] | 虛擬資產合約 [A604A] | 總數 [A605] |
|---|---|------------------|----------------|----------------|-----------------|------------------|-------------------|--------------|
| (a) 交易 | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (b) 其他 (請註明) | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| | | [A606] | [A607] | [A608] | [A609] | [A610] | [A610A] | [A611] |
| [A606A] | | | | | | | | |
| | | [A612] | [A613] | [A614] | [A615] | [A616] | [A616A] | [A617] |
| (c) 與衍生工具有關的交易收入總額 (a) + (b) | | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| (d) 持牌法團的收入總額 (附註 2) | | | | | | | | 0 [A618] |
| (e) 與衍生工具有關的交易收入總額佔持牌法團的收入總額的百分率 (c)/(d) x 100% | | | | | | | | 0% [A619] |
| 附註 1: | 凡持牌法團的衍生工具交易活動包括衍生工具合約及關連現貨投資工具的交易。與衍生工具有關的交易利潤及虧損，應包括來自衍生工具合約及關連現貨投資工具的交易利潤及虧損。如持牌法團採用另一種方法計算與衍生工具有關的交易收入，請在下方指明該等所依據的方法及取向。 | | | | | | | |
| | [A620] | | | | | | | |
| 附註 2: | 即持牌法團的整體收入總額 (包括所有衍生工具及非衍生工具業務的收入)。 | | | | | | | |

就槓桿式外匯交易獲發牌的持牌法團持有與之維持的外幣持倉的
認可對手方的名單

申報月份終結時的狀況

[1004]

(附註 1)

| 行 | | 認可對手方名稱 | 合資格準則 (請按附註 2 填上 適當的合資格準則) | 行 |
|------|--------|---------|----------------------------------|-------------|
| [1] | [B100] | | | [B101] [1] |
| [2] | [B102] | | | [B103] [2] |
| [3] | [B104] | | | [B105] [3] |
| [4] | [B106] | | | [B107] [4] |
| [5] | [B108] | | | [B109] [5] |
| [6] | [B110] | | | [B111] [6] |
| [7] | [B112] | | | [B113] [7] |
| [8] | [B114] | | | [B115] [8] |
| [9] | [B116] | | | [B117] [9] |
| [10] | [B118] | | | [B119] [10] |
| [11] | [B120] | | | [B121] [11] |
| [12] | [B122] | | | [B123] [12] |
| [13] | [B124] | | | [B125] [13] |
| [14] | [B126] | | | [B127] [14] |
| [15] | [B128] | | | [B129] [15] |
| [16] | [B130] | | | [B131] [16] |
| [17] | [B132] | | | [B133] [17] |
| [18] | [B134] | | | [B135] [18] |
| [19] | [B136] | | | [B137] [19] |
| [20] | [B138] | | | [B139] [20] |
| [21] | [B140] | | | [B141] [21] |
| [22] | [B142] | | | [B143] [22] |
| [23] | [B144] | | | [B145] [23] |
| [24] | [B146] | | | [B147] [24] |
| [25] | [B148] | | | [B149] [25] |
| [26] | [B150] | | | [B151] [26] |
| [27] | [B152] | | | [B153] [27] |



的財務申報表

| | | | | | |
|------|--------|--|--|--------|------|
| [28] | [B154] | | | [B155] | [28] |
| [29] | [B156] | | | [B157] | [29] |
| [30] | [B158] | | | [B159] | [30] |

附註 1： 本表格應按每季基準申報，即只需申報 3 月、6 月、9 月及 12 月時的狀況。

附註 2： 就本表格而言，合資格準則指：

- (a) 認可財務機構；
- (b) 就槓桿式外匯交易獲發牌的持牌法團；
- (c) 就期貨合約交易獲發牌的法團，而該法團在任何指明期貨交易所進行貨幣期貨合約交易；
- (d) 在任何指明期貨交易所進行貨幣期貨合約交易的等同法團；
- (e) 在指明司法管轄區成立為法團和受在該管轄區的指明銀行規管當局規管的銀行；
- (f) 已發出繼續獲得合資格信貸評級的債務票據的法團；或
- (g) 獲證監會信納予以認可為對手方的機構。

有關認可對手方的合資格準則的詳情，請參閱《證券及期貨(認可對手方)規則》。

表格 12 客戶群及所管理的資產
申報月份終結時的狀況

[1004] (附註 1)

A. 客戶群

活躍客戶的數目 (附註 2)

(i) 按服務種類及客戶所在處劃分 (附註 3)

| | 行 | 香港 | 中國內地 | 亞太地區(香港及中國內地除外) | 美國 | 其他 | 總數 | 行 |
|------------------------|------|----|------|-----------------|----|----|----|------|
| 證券客戶 (進行股票期權合約交易的客戶除外) | | | | | | | | |
| - 現金客戶 | [1] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [1] |
| - 滾存結餘現金客戶 | [2] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [2] |
| - 保證金客戶 | [3] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [3] |
| | [4] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [4] |
| 期貨客戶及期權 (包括股票期權) 客戶 | [5] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [5] |
| 槓桿式外匯交易客戶 | [6] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [6] |
| 持牌法團向其提供以下服務的客戶 | | | | | | | | |
| - 就證券 / 期貨合約提供意見 | [7] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [7] |
| - 就機構融資提供意見 | [8] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [8] |
| - 資產管理 | [9] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [9] |
| 虛擬資產 (包括構成證券的虛擬資產) 客戶 | [9A] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [9A] |
| 其他 | [10] | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [10] |

(ii) 按客戶種類劃分

機構專業投資者 (附註 4)

法團專業投資者 (附註 4)

個人專業投資者 (附註 4)

其他 (附註 4b)

總數

| | |
|---|---------|
| 0 | [C106A] |
| 0 | [C106B] |
| 0 | [C106C] |
| 0 | [C106D] |
| 0 | [C106E] |

B. 所管理資產的合計淨值(按投資策略及帳戶種類劃分)
(須由就第 9 類受規管活動獲發牌的持牌法團申報)

| | 集體投資計劃 (不包括開放式基金型公司) | | 開放式基金型公司 | | 委託帳戶 | | | 其他資產管理 客戶 (附註 5) | 總額 | | |
|---|-------------------------|------------|------------|------------|--|-----------------|--|------------------------|------------|----------|-------|
| | 獲證監會認可 | 其他 | 獲證監會認可 | 其他 | 由 (i) 持牌法團的董事、股 東或僱員，或 (ii) 由持牌法團的集團聯 屬公司擁有的委託帳 戶 | 其他個人擁有的委託 帳戶 | 其他委託帳戶 (包括官方實體、非集 團聯屬企業、機構專 業投資者及退休基金 等帳戶) | | | | |
| | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | (HK\$'000) | | |
| - 對沖基金策略 (A) | [11] 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [C106F] | [11] |
| - 私人股本策略 (B) | [12] 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [C106G] | [12] |
| - 被動型指數跟蹤策略 (在以上 (A) 及 (B) 所申報的項目除外) (C) (附註 6) | [13] 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [C106H] | [13] |
| - 虛擬資產 / 虛擬資產衍生工具策略 (包括構成證券的虛擬資產) (CA) | [13a] 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [C106HA] | [13a] |
| - 其他策略 (D) | [14] 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | [C106I] | [14] |
| 所管理資產的合計淨值總額 = (A) + (B) + (C) + (CA) + (D) | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | | |
| | [C107A] | [C108A] | [C107B] | [C108B] | [C109A] | [C109B] | [C109C] | [C109D] | [C110] | | |

附註 1: (a) 本表格須由受指明發牌條件規限及僅就以下一項或多於一項活動獲發牌的持牌法團按半年期的基準呈交：就證券提供意見、就期貨合約提供意見、就機構融資提供意見、提供資產管理或提供信貸評級服務。
(b) 附註 1(a) 所述的持牌法團以外的持牌法團須按每季基準呈交本表格，即該等法團須呈報 3 月、6 月、9 月及 12 月的情况。

附註 2: (a) 活躍客戶即符合以下說明的客戶：
(i) 持牌法團須按照《證券及期貨(成交單據、戶口結單及收據)規則》，就有關申報月份製備並向其交付戶口月結單的客戶；或
(ii) 持牌法團因在過去 3 個月內(如持牌法團僅按半年的基準呈交本表格，即為過去 6 個月內)向其提供諮詢服務(包括就證券、期貨合約或機構融資提供意見)或資產管理服務而獲取報酬的客戶。
(b) 凡客戶從持牌法團獲取多於一類受規管活動 / 虛擬資產服務，該客戶須在每類相關受規管活動 / 虛擬資產服務中算作一名活躍客戶。

附註 3: 客戶所在處指客戶提供的通訊地址所在之處。

附註 4: (a) 有關“機構專業投資者”、“法團專業投資者”及“個人專業投資者”的定義，請參閱《證券及期貨事務監察委員會持牌人或註冊人操守準則》第 15.2 段。
(b) 持牌法團應根據其最新評估結果，填妥本表。

附註 5: 請註明：
[Redacted Box] [C111]

附註 6: 就非純粹被動型指數跟蹤策略 (例如 Smart Beta) 而言，有關的所管理資產應在“其他策略”一項下申報。