

香港交易及結算所有限公司

風險管理委員會的 職權範圍及運作模式

1. 為符合《證券及期貨條例》第 65 條，香港交易所須根據其《公司組織章程細則》第 104 條成立風險管理委員會，就香港交易所、香港聯合交易所（「聯交所」）、香港期貨交易所（「期交所」）、香港中央結算公司（「香港結算」）、香港期貨結算公司（「期貨結算公司」）及香港聯合交易所期權結算所（「聯交所期權結算所」）的營運所涉及的風險管理事宜制定政策，並將有關政策提交香港交易所董事會審議。

2. 具體而言，風險管理委員會負責 –
 - a. 檢討及評估香港交易所行政人員用以識別、計量、管理及／或控制風險的政策及方法以及相關的建議變更。有關風險包括可能對證券及衍生產品市場以及香港交易所及其屬下交易所公司及結算所執行的交易、結算及交收職能構成影響的法律風險、信貸風險、市場風險、集中風險、營運風險、環境風險、行為風險及系統風險；

 - b. 檢討及評估香港交易所就重大風險範疇制定的政策，包括但不限於結算所風險管理措施、結算所儲備／保證基金政策及第三者結算事宜；

 - c. 根據香港交易所行政人員匯編的市場報告，監察有關證券及衍生產品市場的跨市場監督職能，以及評估本地及海外市場趨勢及發展對香港證券及衍生產品市場可能造成的影響；

 - d. 審閱香港交易所及其屬下交易所及結算所制定的市場緊急應變計劃（包括與交易及結算系統有關的計劃），並就此提供意見；

- e. 審議委員會成員所提出或由香港交易所行政人員或其董事會所轉告、可能對香港證券及衍生產品市場的穩定及健全構成影響的事宜，並就此提供意見；及
 - f. 將有關上述事宜的建議提交董事會審議。
3. 風險管理委員會於履行其職責及職能時，須注意香港交易所根據《證券及期貨條例》作為認可控制人的責任：

「任何身為認可交易所或認可結算所的控制人的認可控制人，有責任在合理地切實可行的範圍內，確保(a)在該交易所營辦的證券市場或期貨市場或透過該交易所的設施買賣證券或期貨合約是在有秩序、信息靈通和公平的市場中進行的；(b)透過該結算所的設施結算或交收任何證券或期貨合約的交易是在有秩序、公平和快捷的結算及交收安排下進行的；(c)審慎管理與其業務及營運有關聯的風險；(d)該所遵從根據任何成文法則或法律規則施加於該所的合法要求或規定，及遵從施加於該所的其他法律規定。」；

而

認可控制人須「(a)以維護公眾利益為原則而行事，尤其須顧及投資大眾的利益；及(b)確保一旦公眾利益與該控制人的利益有衝突時，優先照顧公眾利益。」。

完。