|  |
| --- |
| **問卷VA-1 — 虛擬資產交易平台營運者問卷**證監會依據《證券及期貨條例》（第571章）和《打擊洗錢及恐怖分子資金籌集條例》（“《打擊洗錢條例》”）（第615章）指明的表格 |

**註釋**

如你回答下列問題時所述的任何政策、程序、系統或監控措施並未實施，請註明有關政策、程序、系統及監控措施預計實施的時間表。

除非另有界定，否則本問卷內所用的詞彙與《適用於虛擬資產交易平台營運者的指引》（“**《虛擬資產交易平台指引》**”）所界定的詞彙具有相同涵義。

你可提供你認為適當的相關政策、程序及流程圖的副本，以便我們了解有關事宜。

如需更多空位，請在申請表的“額外文件”一欄下另附文件，並互相提述相關問題的所有答案。

**I. 業務運作概覽**

1. 請說明你有否從事自營交易，及你的集團公司或聯屬公司有否投資虛擬資產或持有虛擬資產的自營交易持倉？如有，請說明你持有自營交易持倉的目的。

1. 請提供按各業務職能分類的詳細組織架構圖。

1. 請註明轉授予另一實體（包括你的集團公司或聯屬公司）並將不會由你來履行或執行的職能（如有）。請逐一說明有關職能是否由你的集團實體履行或執行，是否被外判予外部第三方，或你有否依賴任何專家或顧問。請同時說明此舉屬一次性安排還是經常性委任，是否將會訂立服務協議，以及將會或已經進行哪些盡職審查，以確定有關外部第三方、專家或顧問的經驗及資格等，從而確保適當性。

1. 請闡述有關你向證監會匯報事故的政策，包括(a)任何沒有遵守你的發牌條件或任何適用法律、規例、守則、指引或常見問題等的情況；(b)在你的平台上的任何不尋常或可疑活動；(c)你的交易、會計、結算及交收系統的任何重大故障或中斷；及(d)專家或顧問識別出的任何重大問題。

1. 當作出建議或招攬行為時，平台營運者會如何：
	1. 在考慮其所察覺的或經進行盡職審查後理應察覺的關於客戶的資料後，確保其向該客戶作出的建議或招攬行為，在所有情況下都是合理的（見《虛擬資產交易平台指引》第9.20段）；

* 1. 確保就複雜產品進行的交易在所有情況下都是適合客戶的（見《虛擬資產交易平台指引》第9.22段）；

* 1. 判斷某虛擬資產可否被視為非複雜或複雜產品（見《虛擬資產交易平台指引》第9.22段註1及2）；

**II. 財務穩健性**

請參考《證券及期貨（財政資源）規則》（“《財政資源規則》”）及／或《虛擬資產交易平台指引》的規定以填妥本節。如有需要，請向你的核數師徵詢有關虛擬資產的會計及《財政資源規則》處理方法的意見。

1. 請說明你能否全面遵守《財政資源規則》下的最低速動資金規定及《虛擬資產交易平台指引》第6.1段下的流動資產規定。

1. 請列明你的資產負債表上的所有主要項目。請同時闡述根據《財政資源規則》及／或《虛擬資產交易平台指引》對每個項目的處理方法，並引述《財政資源規則》及／或《虛擬資產交易平台指引》（如適用）的相關章節。

1. 請闡述你的核數師擔任虛擬資產交易平台營運者及其有聯繫實體的能力，包括其為虛擬資產相關業務進行審計的經驗和往績紀錄。

1. 你建議在獲發牌後對業務活動、營運、系統及監控措施作出的修改，將可能會如何影響到你的損益（以千港元計）？
2. 影響是一次性的
* 有關系統開發／優化／檢視的顧問費
* 法律及其他專業人士費用
* 員工成本（裁員賠償／遣散費）
* 其他（請註明主要項目的性質）
1. 影響是持續性的

* 你的每月成交量
* 你的每月費用收入
* 你的其他每月收入
* 你的每月營運開支

1. 請提供以下資料或估算：

|  |  |
| --- | --- |
|  | **（千港元）** |
| 截至最近一個月底為止的股東資金  |       |
| 經扣除將產生的一次性開支（見第9(a)段）後的股東資金  |       |
| 在獲發牌後首12個月來自費用和收費（包括交易、納入、保管及任何其他費用和收費）所產生的預期總收入 |       |
| 在獲發牌後首12個月的預期總營運開支 |       |
| 將於未來12個月注入的資金的款額  |       |

1. 在適用的情況下，請
2. 列明在截至最近一個月底為止你的財務報表或管理帳目中確認的虛擬資產的名稱及款額；

1. 註明該等虛擬資產的分類，即現金及現金等值、金融資產（現金及現金等值除外）、無形資產、存貨或其他（請註明）；及

1. 說明為你本身的帳戶而持有的虛擬資產所適用的會計政策。

*（請選擇所有適用的選項。）*

[ ]  虛擬資產乃透過損益帳按公平價值計量。

[ ]  虛擬資產乃透過其他全面收入表按公平價值計量。

[ ]  虛擬資產乃按成本計量。

[ ]  其他（請註明）。

1. 請說明代客戶持有的虛擬資產所適用的會計政策。

*（請選擇所有適用的選項。）*

[ ]  在你的財務報表中被確認為資產並按公平價值計量。等值金額（包括有關虛擬資產其後的公平價值變動）被確認為負債，以反映須向有關客戶退回有關虛擬資產的責任。

[ ]  在你的財務報表中被確認為資產並按購買日期的成本或存入日期的市價計量。等值金額被確認為負債，以反映須向有關客戶退回有關虛擬資產的責任。然而，其後將不會對有關資產及負債作出公平價值調整。

[ ]  沒有在你的財務報表中確認為資產，亦沒有在財務報表中將須向有關客戶退回有關虛擬資產的責任確認為負債。

[ ]  其他（請註明）。

**III. 獲納入以供買賣的虛擬資產**

1.
2. 就將獲納入以供在你的平台上買賣的虛擬資產而言，請闡述納入規則及準則和納入程序。尤其是，你是否設有委員會，負責訂立、實施及執行有關規則、準則及程序？請說明此委員會的組成及職權範圍。

1. 請闡述你就將獲納入你的平台以供買賣的虛擬資產進行盡職審查的程序，以及你會否考慮《虛擬資產交易平台指引》第7.6段下的所有因素。

1. 請闡述你在納入有關虛擬資產以供零售客戶買賣前，為確保有關虛擬資產屬高度流通的合資格大型虛擬資產（即此特定虛擬資產應已獲納入由至少兩個不同指數提供者所推出的至少兩個獲接納的指數當中）而設立的程序（見《虛擬資產交易平台指引》第7.8段）。

1. 你有否制訂有關暫停和撤銷虛擬資產在你的平台上買賣的政策？請闡述你為持續監察獲納入以供買賣的虛擬資產而制訂的程序，藉此確保遵守納入規則和準則，以及你就暫停和撤銷虛擬資產在你的平台上買賣所制訂的政策及程序。

1. 當在平台上買賣的虛擬資產出現不利消息或異常情況時，你將會執行甚麼程序及如何處理該虛擬資產和有關的客戶？

1. 請說明現時在你的平台上買賣的所有虛擬資產是否都符合第13(a)段所提述的納入規則及準則。如否，請說明為撤銷有關虛擬資產所採取或將採取的步驟（如適用）。

1. 你有否就安排虛擬資產掛牌獲得報酬，及你有否安排它們掛牌以換取某個數額的虛擬資產？你有否同時就有關掛牌持續地獲得報酬？如有，你如何確保市場享有透明度，及你如何防止將會不利於你的客戶或市場的交易活動（例如設立監控措施以防止或管理利益衝突或“超前交易”）？

1. 請闡述你在處理因（其中包括）硬分叉（hard fork）或空投（airdrop）而產生的新創數碼資產方面的政策及程序。

**IV. 與客戶進行交易**

**認識你的客戶**

1. 請闡明你為評估某客戶是否《證券及期貨條例》附表1第1部第1條所界定的專業投資者而採用的程序。

1. 請闡述你為進行下列評估而採取的程序（包括將向你的客戶收集的資料及你將會考慮的因素）：
2. 客戶對虛擬資產是否有充分認識或了解（包括對虛擬資產所涉及的相關風險有所認識）（見《虛擬資產交易平台指引》第9.4段）；

1. 虛擬資產的交易是否符合客戶的投資目標、財務狀況及風險狀況／胃納；及

1. 商號在向對虛擬資產並無認識的客戶提供服務時有否以維護客戶最佳利益的態度行事。

如客戶被評估為對虛擬資產並無認識或了解或認識或了解不足，請闡述你會採取的步驟。例如，你會否拒絕該客戶的開戶申請，限制其進行交易活動或向其提供培訓。

1. 請闡明你為評估客戶的資產淨值是否能承擔投資損失而設立的程序（包括將向你的客戶收集的資料及你將會考慮的因素）。

1. 請闡述你的“認識你的客戶”及與客戶建立業務關係的政策及程序，包括所採用的系統或技術、風險狀況釐定方法，以及你將會向客戶索取的資料及文件。請同時說明你的互聯網規約（IP）地址監察程序。

1. 請說明你在開戶程序中為核實客戶身份而採取的監控措施。

1. 請說明你是否有納入任何虛擬資產以供零售客戶買賣的任何計劃或建議。如有，你將如何：
2. 評估客戶的風險承受水平及風險狀況，據以釐定客戶的風險狀況，及評估客戶是否適合參與虛擬資產的交易（見《虛擬資產交易平台指引》第9.6段）；

1. 在參照客戶的財政狀況（包括客戶的淨資產）及個人情況後，為每名客戶設定上限，以確保客戶就虛擬資產所承擔的風險根據平台營運者的判斷是合理的（見《虛擬資產交易平台指引》第9.7段）；

1. 請說明在開戶程序中你為確定以下人士的身份、地址及聯絡詳情而採取的監控措施：就為帳戶進行的交易而言，最初負責發出該等交易指示的人士；及該帳戶的實益擁有人。

1. 如在第19、20及21段所述的監控程序中曾應用任何系統或技術（例如容貌識別和檢查身份證明證件的防偽特徵），請闡述為評估系統／技術的適當性及有效性而採取的測試或評核程序，以及闡明你如何能遵守本會至今發出的有關常見問題所闡釋的證監會規定。

1. 請闡述你在透過非面對面的途徑與客戶建立業務關係時，為紓減當中涉及的假冒風險而採取的額外措施。此外，請闡述你為處理提供了不完整或可疑識別資料的準客戶而採取的措施。

1. 請闡述你為確保對客戶資料作出的任何修改獲適當授權，獲證明文件妥為支持，以及獲正確地輸入客戶的主數據庫而已實施的監控措施。

1. 請闡明你為確保遵守《打擊洗錢及恐怖分子資金籌集條例》（第615章）、其附屬條例及相關指引而制訂的政策及程序。請同時闡述你為了識別出與洗錢及恐怖分子資金籌集（“洗錢／恐怖分子資金籌集”）有關的個人和可能屬《聯合國（反恐怖主義措施）條例》（第575章）所指定的人士，以及評估某特定客戶或業務關係所引致的洗錢／恐怖分子資金籌集風險，而在篩查準客戶及任何實益擁有人（如適用）方面的程序、頻密程度及時間。

**開戶文件**

1. 請提供你的標準客戶協議或職權範圍連同所有開戶文件及風險披露聲明的副本。

**給予客戶的資料**

1. 請提供在你的網站上刊載的資料（包括但不限於你的保險單及業務恢復計劃）的副本，並將可供公眾查閱與僅供客戶查閱的資料加以區分。或者，請向我們提供一個示範帳戶，以展示已與你建立業務關係的客戶將可在你的網站上看到的資訊。

1. 你的功能文件向客戶提供的詳情達到甚麼程度（包括收費結構、市場模式及買賣指示的種類）？請提供上述文件的副本。

1. 你有否在你向客戶提供的技術規格文件內列明所有訊息、要求、回應、錯誤代碼及狀況更新？有否提供例子？請提供上述文件的副本。

1. 你有否提供一個採用與實際運作環境相同的代碼庫並具有充足的模擬交易指示活動的模擬環境，以便客戶進行應用程式測試？

1. 請說明負責提供功能及技術支援的員工的數目及所在地點，以及有關支援是否每天24小時提供？

1. 一旦發生緊急情況及系統中斷（例如觸發了熔斷機制、交易暫停／休止、交易恢復及其他事故），你如何與客戶通訊？

1. 請說明在你的平台登載或向你的客戶提供有關虛擬資產的產品資料的種類。請參閱《虛擬資產交易平台指引》第9.27及9.28段。

1. 請提供有關買賣及處理因（其中包括）硬分叉（hard fork）或空投（airdrop）而產生的新創數碼資產的條款及條件或向客戶作出的其他披露的副本。

1. 請說明有否向客戶提供戶口結單。如有，請列明有關代客戶持有的資產的估值政策，並說明是否已向客戶披露有關政策。尤其是，請列明有關流動性較低的虛擬資產（包括硬分叉（hard fork）及被暫停買賣的虛擬資產）的估值政策。

**V. 買賣及交收**

1. 投資者可如何接達你的交易平台 ──
2. 你所屬商號是否容許客戶利用應用程式界面（Application Program Interface，簡稱API）透過其他第三方的交易指示管理系統及／或互聯網瀏覽器接通你的交易平台？

1. 海外投資者可否接達你的交易平台？如在接達你的平台方面設有任何資格準則，請詳加說明。

1. 當用戶接達你的交易平台時，你如何認證他們的身份（例如一次性密碼），並確保只有真正的客戶（而非其他未經授權的人士）才可接達你的平台？

1. 請闡明你如何防止登入資料被第三方及內部僱員竊取。

1. 客戶的交易帳戶 ──
* 請說明你的帳戶管理政策，包括不同的帳戶種類、帳戶層級及任何帳戶限額。

* 請闡述你為客戶交易帳戶制訂的保障安排（當中可能包括雙重認證、交易指示及交易的立即／及時通知、監察及監督機制、數據加密、密碼政策和網頁超時監控措施等）。

1. 請簡述你的交易系統／平台，尤其是：
2. 請闡明你的買賣盤紀錄冊安排。會否透過定期競價、持續交易、報價要求或上述部分／全部方式進行買賣？請闡明在有關安排下交易指示如何互動，並以圖示說明。如適用，請同時闡明有關在平台以外進行交易及將交易指示轉發至其他交易平台的安排。

1. 你的平台提供哪類買賣報價？報價會否是虛擬資產對虛擬資產的報價，或是虛擬資產對非虛擬資產的報價，還是兩者皆有？

1. 你提供哪些種類的交易指示？例如：
* 如支援止蝕指示，則止蝕指示在記入買賣盤紀錄冊時的優先次序為何？

* 如你支援“冰山指示（iceberg order）”，有關隱藏交易指示在記入買賣盤紀錄冊時的優先次序為何？

請註明你提供的所有其他交易指示類型的優先處理次序。

請闡述你的交易平台的交易指示機制。如屬按價格／時間安排優先次序的程式，你如何確保優先次序是按價格／時間排列？

1. 如在過程中提供莊家／流通量服務，請詳細說明有關的莊家／流通量提供者和其背景及經驗，以及你就這些莊家／流通量提供者進行的盡職審查。請同時夾附有關提供莊家／流通量服務的條款及條件（如有）的副本。

1. 請說明當你就在你的平台上買賣的虛擬資產釐定價格時，你會否查閱其他交易平台的買賣盤紀錄冊。請同時說明會否有任何交易指示被轉發至其他交易平台執行。

1. 就你的平台所提供的價格（買／賣）及執行的交易而言，請闡述你會向投資者發布哪些相關數據和如何發布，以及會將哪些相關數據備存作審計線索和如何備存。

1. 請闡述你的交易指示記錄及處理安排和政策（包括透過電話接獲的交易指示（如適用））。

1. 請闡述在你的平台以外進行交易的安排（如有）。
2. 請說明在平台以外的交易安排的運作程序。
3. 如在過程中提供莊家／流通量服務，請詳細說明有關的莊家／流通量提供者和其背景及經驗，以及你就有關莊家／流通量提供者進行的盡職審查。請同時夾附有關提供莊家／流通量服務的條款及條件（如有）的副本。

1. 請分別就在平台上及在平台以外進行的交易，闡述交易確認和交易後交收程序（包括轉移虛擬資產及資金（如適用）），並提供有關程序的圖示。

**利益衝突**

1. 請說明你或你任何有聯繫者：
* 會否投資虛擬資產及持有自營交易持倉；

* 會否作為在你的平台上執行的交易的對手方；

* 會否為你的客戶進行任何背對背交易（不論是在平台上或在平台以外進行），以及會否將有關交易的價格標高或對有關交易施加價差；及

* 會否在你的交易平台上就虛擬資產從事任何莊家交易。

1. 在下列或任何其他情況（如適用於你）中，你如何防止或管理任何可見、潛在或實際的利益衝突：
* 你的員工買賣虛擬資產。請同時提供你的員工交易政策（如有）；及

* 你或你任何有聯繫者從產品發行人（不論是直接或間接）收取任何金錢或非金錢收益，以容許虛擬資產在你的平台上買賣。

請在你的回覆中註明以上哪個情況（及任何其他涉及利益衝突的潛在情況）可能適用於你，並闡明你在各情況中防止或管理利益衝突的政策及程序，包括但不限於確保客戶的交易指示獲優先處理。

**監察／監督**

1. 你有何交易監察程序，以識別可疑的洗錢／恐怖分子資金籌集交易？

1. 請同時註明提供監督系統以便你進行上述監察的顧問（如有）的名稱。

1. 請闡明你在客戶提存法定貨幣及虛擬資產方面的交易監察程序。

1. 請註明你在下列較高風險的情況中，用作識別潛在的可疑洗錢／恐怖分子資金籌集交易的所有預警跡象指標，並闡述相應的跟進行動：

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **較高風險的情況**  | 1. **預警跡象指標**
 | 1. **跟進行動**
 |
| [ ]  客戶或客戶的實益擁有人為政治人物，或業務關係被評估為具有高風險 |       |       |
| [ ]  使用代理人，任何無法核實或高風險的地理位置，任何可隨意丟棄的電郵地址或流動電話號碼，或客戶不斷更換裝置以進行交易 |       |       |
| [ ]  涉及有疑似犯罪元素的錢包地址的交易，例如“暗網（darknet）”市場交易或涉及混幣（tumbler）的客戶交易；及 |       |       |
| [ ]  涉及風險較大或匿名度較強的虛擬資產（例如掩蓋使用者身份或交易詳情的虛擬資產）的客戶交易； |       |       |
| [ ]  複雜、款額大得異乎尋常或進行模式異乎尋常的客戶交易，或無明顯經濟或合法目的的客戶交易 |       |       |
| [ ]  其他，請註明： |       |       |

1. 請闡述有關監察客戶帳戶的任何安排，例如低結餘及高交易量和任何為停止客戶活動而採取的行動。

1. 請闡述你為監察異常及高風險狀況（例如大額價差及大幅波動）而採取的措施（如有）。你的平台有否為虛擬資產交易設立市場波動調節機制？如有，請闡述。

1. 請闡述你如何對你平台上的交易活動進行監督，及你如何設定參數，以識別市場操縱或違規交易活動（包括透過專業第三方進行市場監督的安排）；及你如何處理在這過程中發現的市場操縱或違規交易活動（請詳細說明當中涉及的程序）。

**VI. 風險管理**

1. 請闡述與你的業務活動相關的風險，以及你目前為管理和紓減該等風險而採用的風險管理措施。特別是，請註明為管理對手方及市場風險而實施的措施，包括你在釐定和監察每名客戶獲編配的持倉限額（每項虛擬資產）及交易限額（每名客戶的所有虛擬資產總額）時所採取的程序和任何其他有關的風險管理措施。

**VII. 網絡保安風險管理程序及業務應變計劃**

1. 請闡述負責網絡保安管理的關鍵人員的角色、責任及相關資格，提供顯示出匯報途徑的組織架構圖，並闡明有關的網絡保安風險管理框架及管治架構。

1. 你過去有否遇到任何網絡保安事故？請闡述你在網絡保安事故上的應對及匯報安排，包括應以何種方式上報及匯報懷疑或確實的網絡保安事故。

1. 請提供有關你為偵測及預防潛在網絡攻擊而採用的機制及工具的詳細資料，當中可能包括入侵防禦系統（Intrusion Prevention System，簡稱“IPS”）、入侵偵測系統（Intrusion Detection System，簡稱“IDS”）及針對這些系統進行的任何測試。

1. 你採用哪類主要的儲存媒體？如採用硬件安全模組（Hardware Security Module，簡稱HSM），該模組達到甚麼評級（例如FIPS 140-2第3級）？

1. 請提供有關你為偵測應用層面的漏洞而進行的應用測試的詳細資料。

1. 請提供有關你的分散式阻斷服務（Distributed Denial of Service，簡稱“DDoS”）攻擊防禦機制的詳細資料。

1. 請闡述對你的保安及科技相關安排進行定期內部檢討和演習的既定程序，當中須顧及科技持續發展的情況。

1. 請就對資訊科技系統及網絡保安抵禦能力的充足性所進行的定期獨立評估和最近期的評估（如適用）提供有關資料。

1. 你所屬商號曾否遇到任何導致服務中斷、資料外洩或資產損失的網絡攻擊？如有，請簡述有關事故及所採取的糾正措施。

1. 請闡述你的網絡基礎設施，包括妥善的網絡隔離措施和避免關鍵系統及客戶數據遭受網絡攻擊的保護措施。

1. 請闡述你的應用程式保護安排，以及你如何確保你的應用程式邏輯在為你的平台處理交易和處理各種例外情況時正確無誤。

1. 請闡述你的修補管理程序，並闡明該程序可如何處理潛在漏洞。

1. 請闡述你的端點保護安排，包括所採納的防毒及抗惡意軟件解決方案和更新政策。

1. 請闡述你的使用者接達管理及身份核實程序，並提供有關程序（如有）的副本。請同時詳細說明如何執行角色分隔和最小權限原則。

1. 你有否就執行系統升級及維護訂立書面標準運作程序？

1. 該標準運作程序是否包含通訊的方式，如何處理仍在買賣盤紀錄冊且有待執行的交易指示，以及在系統停機後及在恢復持續交易前有多少時間輸入、更改或取消交易指示？

1. 該標準運作程序是否涵蓋適用於在預期及計劃之外，並可能對有序市場構成影響的系統故障的程序？

1. 你如何向你的客戶提供有關該標準運作程序的資訊？

1. 如你計劃中斷系統以進行更新及測試，而有關中斷可能會對你的客戶構成影響，客戶將會獲多少天的事先通知？

1. 一旦發生連接問題、系統中斷或交易暫停等預期以外的系統故障，你會如何及最快於何時就該事故及預計的持續時間通知你的客戶，以及根據標準運作程序，在平台上有待執行的交易指示和提存將如何處理？

1. 請闡述你的系統、數據備份及數據保護安排，包括如何將紀錄、交易資料及證明文件等備份，如何保護備份文件，以及復原計劃。

1. 請闡述系統升級及維護安排，以及如何紓減為進行重大系統變更而停機所造成的中斷風險。

1. 請闡述你的業務持續運作管理及應變計劃安排，並提供曾進行的應變演習（如有）的資料。

1. 請闡述你所制訂的的實體保安安排，藉此確保關鍵系統組件（例如系統伺服器及網絡裝置）處於安全的環境下，防止有人在未經授權的情況下實際接觸存放著交易平台的設施及關鍵系統組件。

1. 如你的基礎設施保安管理被外判（或某部分被外判）予第三方服務提供者，請闡述你可如何確保被外判的營運工作依然受到充分的保安監控及監督，以及數據和資料的保密性及整全性不會遭到損害。請同時提供第三方服務提供者（如有）的資料（包括有關實體、其背景及經驗等），以及服務協議（如有）的副本。

**VIII. 處理客戶資產**

**客戶提存**

1. 請詳細說明法定貨幣資金提存程序（法定或其他貨幣）及（如適用）相關的銀行安排。

1. 請註明准許採用的提存途徑（例如銀行帳戶、數碼貨幣自動櫃員機站、信用卡），並闡述所制訂的打擊洗錢／恐怖分子資金籌集監控措施。

1. 你是否接受第三方資金提存？

1. 請詳細說明有關將錢包列於允許範圍內的安排和處理虛擬資產提存的程序（包括有否採納有關地址的產生、雙重批核原則、電郵確認和任何其他保障措施）。

1. 當客戶將虛擬資產存入數碼錢包或從數碼錢包提取虛擬資產時，你如何確保有關數碼錢包是屬於該客戶的？

1. 請詳細說明你會在甚麼情況下暫停虛擬資產的提存，你會如何將有關情況告知你的客戶及證監會，以及有關提存會在甚麼條件／情況下恢復。

1. 請說明是否設有存入／提取限額，以及有關限額如何設定。

**保管客戶資產**

1. 請就**屬於你**並與進行有關活動[[1]](#footnote-2)相關**的錢包地址**，提供下列資料：

(a) 處於活躍狀態的完整錢包地址：

(b) 不活動的完整錢包地址：

(c) 被主管當局凍結的完整錢包地址：

就上述錢包地址而言，請同時提供其相關區塊鏈規程的名稱，並註明該（等）錢包地址是否或曾否被指定作持有客戶虛擬資產或屬平台營運者所有的資產。

1. 請就**屬於你的有聯繫實體**並與進行有關活動相關**的錢包地址**，提供下列資料：

(a) 處於活躍狀態的完整錢包地址：

(b) 不活動的完整錢包地址：

(c) 被主管當局凍結的完整錢包地址：

就上述錢包地址而言，請同時提供其相關區塊鏈規程的名稱，並註明該（等）錢包地址是否或曾否被指定作持有客戶虛擬資產或屬平台營運者所有的資產。

1. 請闡述你的錢包架構及基礎設施。尤其是：

(a) 每個錢包的性質（線上或線下；客戶或公司）；

(b) 種子及私人密鑰如何產生；

(c) 私人密鑰的保存地點（例如具有合適認證的硬件安全模組（Hardware Security Module，簡稱HSM）；

(d) 種子及私人密鑰是否按照適用的國際保安標準和行業最佳作業手法產生，從而確保種子或私人密鑰是由可保證隨機性的非決定性方式產生；

(e) 錢包在提存虛擬資產方面的操作，以確保儲存在線上錢包內的客戶虛擬資產不多於 2%。

(f) 備份安排；

(g) 服務／系統／技術提供者（如有）；及

(h) 你曾對該等提供者進行的盡職審查工作。

1. 請說明你的保管職能由誰負責設計及營運和該人的資歷。請同時說明參與保管職能的員工人數和他們各自的角色及職責。

1. 你會對獲授權接觸客戶資產的人員進行甚麼背景篩查？請提供有關人員的名單。

1. 請闡述你如何防止未經授權的僱員存取客戶錢包的私人密鑰。

1. 你是否設有系統及以文件妥為記錄的程序，以對密鑰、種子和與虛擬資產有關的資料施加存取限制？請提供詳情。

1. 如要在你的平台上將虛擬資產從客戶錢包轉移至你的公司錢包，有何程序？

1. 如要將虛擬資產從線上儲存轉移至線下儲存和從線下儲存轉移至線上儲存，有何程序？

1. 請說明你有否就客戶可分別以線下錢包及線上錢包持有或將持有的虛擬資產的百分比設定限額。如有，請註明該限額，並闡述已實施的監察措施，以確保有關限額獲得遵守。

1. 有何程序及系統以保障在線上錢包內持有的虛擬資產？請詳細說明多重簽名錢包、種子及密鑰的產生，熵（entropy）是如何產生的及當中牽涉多少個人，線上錢包的環境在哪裡寄存，任何防止未經授權僱員存取的監控措施，以及管理員存取的程序。

1. 請詳細說明有關線上錢包保安及提取的特定測試。

1. 就你的線下儲存方式而言，請提供有關硬件選擇、冗餘、使用限制及保安的詳情。請同時闡述儲存管理及轉移政策，並提供該政策（如有）的副本。

1. 一旦偵測到對你儲存的虛擬資產造成影響的欺詐性活動，你有何通訊政策？

1. 你採用甚麼系統以偵測欺詐性的客戶交易要求？

1. 是否有為客戶的虛擬資產設立任何分隔安排？如有，請闡述有關安排。

1. 是否有為客戶款項（屬法定貨幣形式）設立任何分隔安排？如有，請闡述有關安排，並提供有關該等帳戶所在銀行的詳情。

1. 請說明某一客戶的虛擬資產會否與你的交易平台上的其他客戶的資產分隔開來。

1. 如客戶是基金經理，請說明有關帳戶將會以基金經理的名義還是以由其管理的相關基金的名義開設或註冊。

**IX. 保險**

1. 請就你計劃為代表你的客戶持有的資產分別投購的保險提供下列資料：

(a) 有關保險在代表客戶持有的資產遭盜竊／挪用／損失方面的保障範圍，並提供有關保單（如有）的副本。

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| **保險公司名稱** | **保險保障詳情** | **保險限額** **（以每個帳戶或虛擬資產類別計）** | **不受保障的自負額／免賠額的金額（以每宗索償計）（如有）** |
|       |       |       |       |
|       |       |       |       |
|       |       |       |       |

請同時註明你是否計劃以你所屬商號本身的資產為客戶資產的任何損失作出賠償。

(b) 旨在應付因網絡保安事故而產生的損失的網絡保安保險

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **保險公司名稱** | **保險保障詳情** | **保險限額** |
|       |       |       |
|       |       |       |
|       |       |       |

(c) 旨在涵蓋主要人為風險的保險保障

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **保險公司名稱** | **保險保障詳情** | **保險限額**  |
|       |       |       |
|       |       |       |
|       |       |       |

(d) 以信託方式撥出並指定作賠償安排的資金（以活期存款或將在六個月內到期的定期存款的方式持有）或虛擬資產（如適用）（見《虛擬資產交易平台指引》第10.22(b)段）

|  |  |
| --- | --- |
|  | **港元** |
| **平台營運者的資金**  |       |
| **與平台營運者屬同一公司集團的任何法團的資金**  |       |

(e) 由認可財務機構提供的銀行擔保（如適用）（見《虛擬資產交易平台指引》第10.22(c)段）

**X. 備存紀錄**

1. 請闡述你的備存紀錄政策，包括你備存紀錄的地點，紀錄保存期，和為確保根據《虛擬資產交易平台指引》第XIV部須予備存的紀錄都是完整、安全、可供取覽、可靠和詳盡的而實施的措施，以及從客戶盡職審查及持續監察的過程中所取得的紀錄。

1. 請說明你有否使用外間電子數據儲存。如有，請提供有關使用外間電子數據儲存的詳情，並安排提交本會就使用外間電子數據儲存而發出的常見問題中列載的所需文件。

**XI. 資料清單**

1. 請提供你就下列範疇所制訂的政策及程序的副本：

• 認識你的客戶、客戶盡職審查及與客戶建立業務關係

• 打擊洗錢／恐怖分子資金籌集

• 網絡保安及資訊保安

• 市場監察

• 交易規則及操作

• 風險管理

• 虛擬資產納入／掛牌規則

• 保管客戶資產、錢包結構、管理及運作

• 交易監察

• 業務應變／災難恢復

• 紀錄保存

• 員工交易

**問卷VA-1 — 虛擬資產交易平台營運者**

**聲明**

**我們：**

* **聲明**在本問卷及一同遞交的任何文件內所提供的全部資料均為完整、真實及正確。
* **明白**在本問卷內或為支持本問卷而提供虛假或具誤導性的資料可能觸犯《證券及期貨條例》第383及／或384條和《打擊洗錢條例》第53ZTO及／或53ZTP及／或53ZTQ條所訂的罪行。
* **明白**證券及期貨事務監察委員會可以對在本問卷內或為支持本問卷而作出虛假或具誤導性陳述的人士採取刑事行動及／或紀律行動**。**
* **明白**如果本問卷或一同遞交的任何文件所載的任何資料在證券及期貨事務監察委員會就任何有關的申請作出決定前發生變更，我們應立即以書面形式通知證券及期貨事務監察委員會該等變更。
* **明白**證券及期貨事務監察委員會可作出其認為適當的該等查詢及索取其認為適當的進一步資料。

**（本聲明必須由法團的兩名董事\*或獲董事局授權人士簽署。）**

|  |  |
| --- | --- |
| **代表：** |       |
|  | 法團名稱  |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|       |  |       |  |       |
| 董事／獲董事局授權人士姓名 |  | 簽署  |  | 日期 |

|  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- |
|       |  |       |  |       |
| 董事／獲董事局授權人士姓名 |  | 簽署  |  | 日期 |

\* 如法團只有一名董事，可由一名董事簽署。

1. “有關活動”一詞的定義載於《虛擬資產交易平台指引》 [↑](#footnote-ref-2)