

新聞公報
立法會十三題：防止外匯交易員的合謀行為
2014年3月26日（星期三）

以下為今日（三月二十六日）在立法會會議上郭榮鏗議員的提問和財經事務及庫務局局長陳家強的書面答覆：

問題：

據報，歐洲、美國及亞洲各地的 10 多個監管機構，最近數月正各自進行調查或協助調查，有關外匯交易員被指以聊天室等電子通訊平台分享客戶資料和合謀操控每日匯價基準（例如共享整體買賣帳冊和個別客戶下單指令的資料，以配對他們的交易和作出協調交易策略）。部分涉事的銀行（當中很多有在香港經營業務）進行的內部調查亦發現該等非法作為。就此，政府可否告知本會，是否知悉香港金融管理局（金管局）和證券及期貨事務監察委員會（證監會）：

（一）有否調查香港外匯市場的交易員有否作出同類的非法作為；如有調查，結果為何，以及如有發現該等情況，金管局和證監會所採取的跟進行動（例如作出刑事檢控等）為何；如未有進行調查，原因為何；

（二）有否評估現時相關規例是否足以阻嚇在香港外匯市場進行交易的交易員作出同類的非法作為；如有評估，結果為何，以及如評估結果為阻嚇力不足，會否及何時檢討相關規例；及

（三）有否評估海外監管機構進行的調查有否導致香港外匯市場出現轉變（例如外匯交易活動縮減、投資者承擔風險的意欲減退等）；如有評估而結果為有導致轉變，該等轉變對香港外匯市場的影響，以及金管局和證監會所採取的跟進行動為何；若否，原因為何？

答覆：

主席：

政府已諮詢金管局及證監會有關提問所涉及兩者的執法和監管職能，現回覆如下：

（一）金管局正就外匯匯率基準被操控事宜調查若干在香港的認可機構，並在過程中與境外銀行監管機構保持緊密聯繫。目前，有關調查正在進行中。

（二）金管局要求認可機構備有足夠的管控制度，以確保進行財資市場業務（包括外匯市場）的員工遵守財資市場公會所發出的《行為及常規守則》（守則）內的嚴格道德行為標準。

該守則訂明適用於香港財資市場（包括外匯市場）的道德行為標準及最佳實務守則。一般而言，該守則規定財資市場公會會員機構應以誠實及公平的手法經

營業務，並維護市場的誠信，以及嚴禁欺詐、欺騙及操控行為。此外，該守則亦規定有關機構應採取一切必須的措施，防止欺詐及其他犯罪行為，並採取一切合理的步驟，確保客戶交易指示乃基於其所能取得的最佳條件執行。該守則亦規定，市場從業員須極度謹慎，恪守保密責任及維護客戶的私隱，並且不應泄露任何已進行或正進行的交易資訊。

(三) 我們從監管機構了解所得，市場反應顯示外匯匯率基準相關調查並未有為香港外匯市場的活動水平帶來任何異常改變。

完