中国证券期货市场衍生品交易确认书

**甲方：东证润和资本管理有限公司**

**乙方：${clientName}**

甲乙双方已签署《中国证券期货市场衍生品交易主协议》（以下简称“**主协议**”） 以及《中国证券期货市场衍生品交易主协议补充协议》（以下简称“**补充协议**”）。本确认书构成主协议下的一份“**交易确认书**”，除非本确认书另有规定，主协议和补充协议中的条款均适用于本确认书。在本确认书与主协议或补充协议出现不一致时，以本确认书的条款为准。

甲乙双方同意，本确认书对交易双方具有法律约束力。

# 一、交易条款

|  |  |
| --- | --- |
| **交易编号** | ${tradeCode} |
| **买方** | ${productBuyName} |
| **期权类型** | ${optionTypeName} |
| **看涨看跌** | ${callOrPutName} |
| **挂钩标的** | ${underlyingCode} |
| **成交日期** | ${tradeDateString} |
| **到期日期** | ${maturityDateString}  如遇非交易日（法定节假日或交易所规定的其他情况），则实际到期日期为前一个交易日。 |
| **采价起始日** | ${obsDateStart}  如遇非交易日（法定节假日或交易所规定的其他情况），则实际采价起始日为后一个交易日。 |
| **采价终止日** | ${obsDateEnd}  如遇非交易日（法定节假日或交易所规定的其他情况），则实际采价终止日为前一个交易日。 |
| **采价日数** | ${obsDateSize}（采价起始日（含）至采价终止日（含）的全部交易日） |
| **交易数量** | ${tradeVolume} ${quoteUnit} |
| **期初价格** | ${entryPrice} 元/${quoteUnit} |
| **行权价格** | ${strike} 元/${quoteUnit} |
| **增强价格** | ${enhancePrice} 元/${quoteUnit} |
| **权利金单价** | ${optionPremium} 元/${quoteUnit} |
| **权利金总额** | ${totalAmount} 元 |
| **权利金支付方向** | 买方向卖方支付权利金总额 |
| **名义本金** | ${notionalPrincipal} 元 |
| **结算方式** | ${settleTypeString} |
| **到期收益结构** | **一、结算方式为头寸时：**   1. 若采价日挂钩标的收盘价格大于行权价格，则买方在该日以行权价格获得期货多单，卖方以行权价格获得期货空单；数量均为：交易数量/采价日数； 2. 如果观察日挂钩标的收盘价格小于等于行权价格，则买卖双方在该日均不获得期货头寸。   **二、结算方式为现金时：**   1. 采集价格 = Max(采价日当日挂钩标的收盘价格，增强价格)； 2. 结算价格 = 挂钩标的在所有采价日的采集价格的算术平均值； 3. 到期收益 = 交易数量×Max[(结算价格-行权价格)，0]。 |
| **平仓收益结构** | 存续期内，乙方有权发起平仓，提前终止本合约，具体收益结构如下：   * + - 1. 结算价格 = 双方约定的触发平仓指令生效的挂钩标的价格或双方约定的其他价格；       2. 平仓收益 = 交易数量×平仓权利金; 其中平仓权利金由甲方依据结算价格计算得出。 |
| **现金结算方向** | 卖方向买方支付现金结算金额。 |
| **对冲干扰事件** | 对冲干扰事件是指挂钩标的在任一观察日内发生的影响观察挂钩标的收盘价格、对冲、交易等的事件。  若挂钩标的在到期日期、采价起始日、采价终止日发生对冲干扰事件，则实际日期向后顺延至未发生对冲干扰事件的第一个交易日。 |

双方确认办理本交易符合己方的交易目的。同时，双方就本交易的各种风险因素（包括但不限于信用风险、市场风险、流动性风险、操作风险、法律风险等）向对手方进行了充分、详细的披露和解释。双方经自主和独立判断，已经完全理解本交易的条款和各种隐含风险，及本交易的最差情况及最大潜在亏损，并对此具有足够的承受能力。

# 二、其他约定

1、乙方若对本交易确认书有异议的，应在收到本确认书后的一个工作日内向甲方书面提出异议，同时说明理由；若甲方未在上述期限内收到乙方的书面异议，则视为乙方接受本确认书所记载的全部内容。

2、在乙方对交易确认书回复确认前或乙方主张未收到甲方发送的交易确认书，双方已按乙方发送交易指令完成交易的，任意一方均不能以未签订交易确认书、交易确认书未生效为由否认已完成的交易效力，以双方其他具有法律约束力的记录为交易有效约定。

3、乙方授权人的交易指令和其它有关指示对乙方有绝对的法律约束力，乙方对被授权人的交易行为承担全部责任。

4、由于各种风险因素的存在，甲乙双方理解其参与交易的目的不一定能够实现，上述后果由交易一方自行承担，交易另一方对此不提供担保也不承担任何责任。

5、本交易确认书所涉及的交易及适用于主协议、补充协议的所有其他交易，违约一方有义务承担由此产生的所有费用和损失。

东证润和资本管理有限公司

（盖章）

${tradeDateString}