**结构化期权产品交易确认书**

# 合同编号： ${tradeCode}

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

|  |  |
| --- | --- |
| **产品发行方** | 东证润和资本管理有限公司 |
| **产品买方** | ${clientName} |
| **产品名称** | ${optionTypeName} |
| **挂钩标的** | ${underlyingCode} |
| **头寸规模** | ${tradeVolume}吨 |
| **每日头寸规模** | ${basicQuantity}吨 |
| **产品买方权利金**  **支付金额** | ${totalAmount}元/吨 |
| **成交日** | ${tradeDateString} |
| **期初观察日** | ${obsDateStart} |
| **期末观察日** | ${obsDateEnd}  如遇非交易日，则顺延至其后第一个交易日；  若挂钩标的在预定期末观察日发生对冲干扰事件，则实际期末观察日向后顺延至产品发行方完成挂钩标的头寸平仓日。 |
| **观察日** | ${obsDateSize}（期初观察日（含）至期末观察日（含）的全部交易日） |
| **结算方式** | 每日期货头寸记账，任一观察日甲方按乙方指令将持仓部分或全部平仓后现金结算，或至期末观察日将全部持仓平仓后现金结  算。 |

|  |  |
| --- | --- |
| **上界价格** | ${upPrice}元/吨 |
| **下界价格** | ${downPrice}元/吨 |
| **入场价格** | ${entryPrice}元/吨 |
| **收益结构** | 1. 如果观察日挂钩标的收盘价小于下界价格，**则乙方在该观察日以下界价格持有${leverage}倍每日头寸规模对应的期货多单；** 2. 如果观察日挂钩标的收盘价小于上界价格且大于等于下界价格，**则在该观察日甲方向乙方支付固定收益${basicQuantity}\*${fixedPayment}=${basicQuantity\*fixedPayment}元；** 3. 如果观察日挂钩标的收盘价大于等于上界价格，**则乙方在该观察日不持有期货头寸。** |
| **提前终止权利** | 产品存续期内，乙方有权提前终止本合约，需支付提前终止成本，  该成本由甲方根据当日市场流动性及市场价格计算得出。乙方签字盖章确认后可提前终止本合约。 |
| **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。 |

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}