场外衍生品交易结算单

尊敬的投资者（投资者名称：{{clientName}}）：

贵司与我司签署了《中国证券期货市场衍生品交易确认书》，双方达成下述场外衍生品交易。

本结算单用于明确下述场外衍生品因平仓产生的双方权利义务。

注：结算盈亏列数据为正，即贵司盈利；

结算盈亏列数据为负，即贵司亏损。

|  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| {{data}}交易编号 | 成交日期 | 到期日期 | 标的合约 | 买卖方向 | 期权类型 | 数量 | 执行价格 | 期初标的价格 | 期初权利金单价 | 权利金收支 | 了结标的价格 | 了结日期 | 结算金额 | 结算盈亏 |
| [tradeCode] | [tradeDateStr] | [maturityDateStr] | [underlyingCode] | [buyOrSellName] | [optionTypeName] | [closeVolume] | [strike] | [entryPrice] | [optionPremium] | [totalAmount] | [closeEntryPrice] | [closeDateStr] | [closeTotalAmount] | [profitLoss] |

东证润和资本管理有限公司

（盖章）

日期：{{closeDateSrt}}

投资者确认：

本机构已阅读了上述告知内容，确认该笔交易的相关结算数据无误，我司同意贵司依据本结算单就双方签署的上述交易确认书进行结算。我司明确知晓双方完成结算资金交收义务后，该交易确认书约定的双方权利义务关系结束。我司若对本交易结算单内容存在异议的，应最晚于下一个交易时段开始前以双方签署的<《中国证券期货市场衍生品交易主协议》补充协议>中约定的形式通知贵司其异议内容，否则视为对本交易结算单内容的认可。