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}}

甲方和乙方以下单独称“交易一方”，合称“交易双方”。交易双方已经签署了《中国证券期货市场衍生品交易主协议（ 2014年版）》（以下称“主协议”）及补充协议，本确认书构成主协议下的一项“交易有效约定”，主协议和补充协议中的全部条款适用于本确认书，除非本确认书中另有约定。

本确认书适用《中国证券期货市场场外衍生品交易商品类衍生品定义文件》及其修改或补充（以下称“商品定义文件”），若本确认书与商品定义文件中的约定不一致，本确认书的相关约定具有优先法律效力。

交易双方同意，本确认书所述条款构成了交易双方之间就本确认书项下交易的完整条款，且对交易双方具有法律约束力。

**交易信息：**

**{{?experiences}}**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易编码 | {{tradeCode}} | 交易日期 | {{tradeDateStr}} |
| 交易到期日 | {{maturityDateStr}} | 交易标的 | {{underlyingCodeByExchange}} |
| 交易方向 | 东证润和资本管理有限公司{{dzBuyOrSellName}} | 交易类型 | {{optionTypeName}} |
| 交易数量 | {{tradeVolumeString}} | 交易单位 | {{quoteUnit}} |
| 期初价格 | {{entryPriceString}} | 执行价格 | {{strikeString}} |
| 单价 | {{optionPremiumString}} | 名义本金 | {{notionalPrincipalString}} |
| 费用支付日 | □同交易日期；■提前终止日或期权到期日 | 总价 | {{totalAmountString}} |

**{{/experiences}}**

结算方式：现金结算

结算价格：1)远期到期前平仓情形下，结算价格为双方约定的触发平仓指令生效的标的价格。

2)远期到期结束情形下，结算价格为到期日标的收盘价

远期到期收益金额：（远期结算价格-固定价格)\*数量

支付方向：远期到期收益金额为正值时，远期卖方向远期买方支付该到期收益金额；远期交易到期收益金额为负值时，远期买方向远

期卖方支付该到期收益金额的绝对值数额。

结算流程：交易结束时甲方向乙方发送交易结算单，乙方对其无异议的，甲/乙方应于收到用印结算单后三个工作日内完成资金支付。

结算账户：参见双方签署的<《中国证券期货市场衍生品交易主协议》补充协议>中约定。

**风险事项：**

"1、场外远期合约标的由甲方根据相关规则选择，乙方仅享有与合约标的价格相关的经济利益或经济损失，并不享有任何作为合约标的持有人具有的权利。

2、在远期存续期间出现合约标的停牌时，甲方将停止对应远期的报价；当场外远期交易出现异常波动或者涉嫌违法违规等情形时，甲方有权停止对远期合约的报价。

3、在市场出现剧烈波动时，或合约标的市场交易量不足或者连续出现单边涨跌停价格时，甲方有权拒绝乙方的远期交易指令，且有权提前终止与乙方已达成的远期交易。

4、如在到期日当日标的合约发生涨跌停板的情况，甲乙双方可以根据其自身判断并依照诚信原则及商业合理惯例提出将到期日顺延到下一交易日，双方协商均同意后方可顺延。如甲乙双方均不提出顺延至下一交易日，或未协商一致，则交易双方以到期日标的合约收盘价进行结算。

5、如顺延后的远期到期日标的合约发生涨跌停板情况，自动触发 4 条款。该等情况下，如甲乙双方均不提出继续顺延至下一交易日，或未协商一致，则交易双方以实际到期日标的合约收盘价进行结算。

6、乙方提前平仓时，若以市价下单平仓，最终成交数量和成交价格以甲方出具的成交数量和成交价格为准。

7、乙方在进行远期交易时，应当保证履约保障金的充足。当履约保障金余额不足时，乙方将无法进行相关远期开仓交易，且将面临已开仓合约被强行平仓等风险，由此产生的强行平仓费用、强行平仓的损失等一切费用和损失由乙方承担。

8、当合约标的发生暂停或终止上市，甲乙双方均有权将本交易的到期日提前至合约标的暂停或终止上市前最后交易日的前一个交易日，当交易一方提出该需求的，交易另一方不得提出异议，本交易于该日到期并行权，或对该等事件作出其他必要调整。

9、当发生不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错、市场操纵等异常情况影响远期交易正常进行时，或者乙方违反相关法律、法规、规章及远期交易规则，甲方有权停止报价服务并对乙方的远期交易进行强行平仓并且不承担因此造成的损失。

10、因不可抗力、意外事件、技术故障、重大差错、市场操纵等异常情况，导致合约条款、结算价格、远期结算支付金额、履约保障标准以及其他重要数据发生错误时，甲方有权对相关数据做出必要调整并通知乙方。

11、乙方保证从事相关交易行为合法合规，甲方不因提供本协议下的服务而遭受损害、被处罚或承担责任。如发生上述情况，乙方将向甲方支付为应对本协议相关之诉讼、监管处罚等而支出的合理费用（包括但不限于律师费、交通费等）。

12、甲方在尽商业合理的努力后，仍不能有效对冲相关风险，或对冲成本明显增加，则甲方有权拒绝乙方的交易指令，或作出其他必要调整，此种情形下不构成甲方对乙方的违约。

13、乙方理解并认同，乙方如提前行权（远期类型为可提前行权情况下），行权价格由甲乙双方协商确定，提前行权价格由甲方结合乙方提前行权时间自行确定对应标的盘中价格或近日收盘价为提前行权价。

14、商品标的结算价以甲方对乙方持仓进行平仓时实际产生的平仓均价为准；若商品标的为外汇产品或涉及汇率转换，由甲方按照市场通用标准确定外汇产品价格或汇率标准，乙方认同甲方在外汇产品价格或汇率标准确定方面的选择权，不因甲方未选择最优时机或价格等方面而向甲方主张权益。"

**甲方：东证润和资本管理有限公司**

**盖章：**

**日期：{{tradeDateEndStr}}**