

合同编号:

碳排放权场外掉期交易合同

2016年7月

甲方 **XXXX** (以下简称甲方) 为于____年____月____日依中国法律设立并合法存续的企业法人, 注册证号: _____。

注册地址/住所:

法定代表人:

电话:

开户银行:

邮编:

账号:

乙方 **XXXX** (以下简称乙方) 为于____年____月____日依中国法律设立并合法存续的企业法人, 注册证号: _____。

注册地址/住所:

法定代表人:

电话:

开户银行:

邮编:

账号:

丙方北京环境交易所有限公司 (以下简称丙方) 为于____年____月____日依中国法律设立并合法存续的企业法人, 注册证号: _____。

注册地址/住所:

法定代表人:

电话:

开户银行:

邮编:

账号:

鉴于：

甲、乙、丙三方根据《中华人民共和国合同法》等相关法律、法规、规章、规则的规定，遵循自愿、公平、诚实信用的原则，经友好协商，签订本合同。

第一条 定义与释义

除非本合同中另有约定，本合同中的有关词语含义如下：

- 1.1 交易日：北京市碳排放权电子交易平台正常开市交易的日期。
- 1.2 保证金：包括初始保证金和维持保证金。
- 1.3 BEA：北京碳排放配额，单位以“吨二氧化碳(tCO₂)”（缩写为吨）计。
- 1.4 公开交易：在北京市碳排放权电子交易平台依据《北京环境交易所碳排放权交易规则》中关于公开交易的相关规定进行的交易。
- 1.5 包括：指包括但不限于。

第二条 交易

- 2.1 标的资产（缩写 A_标）：XXXX 吨 BEA。
- 2.2 即期交易：甲、乙双方同意，甲方于本合同生效日以 XX 元/吨的约定价格（缩写 P_约）向乙方购买标的资产。
- 2.3 远期交易：甲、乙双方同意，乙方于 XX 年 XX 月 XX 日最终结算日，以最终结算价（缩写 P_结）向甲方购回标的资产。

第三条 保证金

3.1 初始保证金。

初始保证金是甲、乙双方在本合同生效后要向丙方缴纳的保证金。初始保证金采用一次性付款方式，甲、乙双方应在本合同生效后第 [5] 个交易日中午 17：00 以前将 XXXX 元初始保证金汇入丙方指定的账户。

3.2 维持保证金。

维持保证金是甲、乙双方用于在最终结算日前用于弥补因 BEA 的价格变化而产生的浮动亏损的保证金。甲、乙双方应在本合同生效后第 [5] 个交易日中午 17：00 以前将 XXXX 元首笔维持保证金汇入丙方指定的账户，此为维持保证金的基准值。

在最终结算完成前，甲、乙双方各自存放在丙方的维持保证金均不得低于该基准值。

第四条 清算与结算

4.1 甲、乙双方同意彼此之间不发生标的资产的实际划转，仅就最终结算价格和约定价格的差额进行资金结算。

4.2 定期清算日：甲、乙双方将初始保证金和首笔维持保证金汇至丙方指定账户的次日算起，每 [10] 个交易日中的第 [10] 日为一个定期清算日。

4.3 定期清算参考价（缩写 P_清）：每个定期清算日之前 [10] 个交易日（不包括该定期清算日当日）的 BEA 公开交易总额与公开交易总量之比，单位为“元/吨”，数字四舍五入至小数点后 2 位。

若该 [10] 个交易日的 BEA 公开交易总量不足 [XXXX] 吨，则在

已纳入的[10]个交易日之外向前追加纳入更早的交易日的 BEA 公开交易量，直至被纳入的交易日的 BEA 公开交易总交易量不低于 [XXXX] 吨。在此情形下，该定期交易日的定期清算参考价等于被纳入的所有交易日的 BEA 公开交易总额与公开交易总量之比，单位为“元/吨”，数字四舍五入至小数点后 2 位。

4.4 维持保证金的清算。

丙方在定期清算日根据定期清算参考价计算甲、乙双方的浮动盈亏。在任意一个定期清算日，根据定期清算结果出现浮动亏损的一方称为浮动亏损方，其对手方称为浮动盈利方。即当 $P_{清} > P_{约}$ 时乙方为浮动亏损方，甲方为浮动盈利方； $P_{清} < P_{约}$ 时，甲方为浮动亏损方，乙方为浮动盈利方； $P_{清} = P_{约}$ 时，甲、乙双方均未出现浮动盈亏。

若浮动亏损方在丙方存入的维持保证金的数额低于其浮动亏损额，则浮动亏损方须在自丙方计算出该浮动亏损额的定期清算日算起第 [5] 个交易日中午 17:00 以前增加其维持保证金的数额直至等于或高于浮动亏损金额。

若浮动亏损方未按要求增加维持保证金，则甲、乙双方同意授权丙方进行强制平仓，将浮动亏损方此刻存于丙方的保证金总额支付给浮动盈利方。甲、乙双方同意在丙方完成强制平仓后，浮动盈利方自愿无条件放弃对浮动亏损方保证金不足弥补浮动亏损部分在本合同下的追索权，本合同提前终止。

4.5 最终结算价的计算。

最终结算价等于最终结算日之前 [20] 个交易日（不包括最终结算日当日）的 BEA 公开交易总额与公开交易总量之比，单位为“元/吨”，数字四舍五入至小数点后 2 位。

若该 [20] 个交易日 BEA 公开交易总量不足 [XXXX] 吨，则在已纳入的 [20] 个交易日之外先前追加纳入更早的交易日的 BEA 公开交易量，直至被纳入的交易日的 BEA 公开交易总交易量不低于 [XXXX] 吨。在此情形下，最终结算价等于被纳入的所有交易日的 BEA 公开交易总额与公开交易总量之比，单位为“元/吨”，数字四舍五入至小数点后 2 位。

4.6 最终结算。

丙方在最终结算日依据最终结算价计算甲、乙双方的最终盈亏结果。根据结果，出现亏损的一方称为亏损方，其对手方称为盈利方。甲、乙双方同意授权丙方进行最终结算，将与亏损方的亏损额相等的资金从亏损方的保证金中扣除，并将该款项划至盈利方名下，然后于最终结算日起 [10] 个工作日内将甲、乙双方的保证金余额支付至双方资金账户，视为最终结算完成，本合同终止。

若亏损方的亏损额大于亏损方于最终结算日存于丙方的保证金总额，则甲、乙双方同意丙方将亏损方的全部保证金划至盈利方名下，盈利方自愿无条件放弃对亏损额与保证金之间的差额在本合同下的追索权，亏损方无需向盈利方支付该差额。

若最终结算日未出现亏损方，则丙方于最终结算日起 [10] 个工作日内将甲、乙双方的保证金余额支付至双方资金账户，本合同终止。

当 $P_{结} > P_{约}$ 时，乙方为亏损方，甲方为盈利方，乙方的亏损额为 $(P_{结} - P_{约}) \times A_{标}$ ；当 $P_{结} < P_{约}$ 时，甲方为亏损方，乙方为盈利方，甲

方的亏损额为 $(P_{\text{约}} - P_{\text{结}}) \times A_{\text{标}}$;当 $P_{\text{结}} = P_{\text{约}}$ 时,甲、乙双方均未出现盈亏。

第五条 交易服务费

5.1 甲、乙双方各自在本合同生效后第[5]个交易日中午 17:00 以前一次性向丙方交纳[XXXXXX]元交易服务费。

第六条 三方的声明与保证

6.1 甲、乙双方对本合同项下的任何交易拥有合法、有效和完整的处分权。

6.2 甲、乙双方为签订本合同之目的向对方及丙方提交的各项证明文件及资料均为真实、准确、完整的。

6.3 甲、乙、丙三方签订本合同所需的包括但不限于授权、审批、公司内部决策等在内的一切手续均已合法有效取得,签订本合同的前提条件均已满足。

第七条 违约责任

7.1 本合同生效后,甲、乙中的一方无故提出终止合同,终止方应将终止日当日存于丙方的保证金总额作为违约金,授权丙方支付至对手方(守约方)账户。守约方自愿无条件放弃对损失与违约金之间的差额在本合同下的追索权。该违约责任视为已经完全解决。

7.2 甲、乙双方中未按合同约定支付初始保证金、首笔维持保证金、交易服务费的一方,应向丙方支付逾期付款违约金。违约金按照延迟支付期间应付价款的每日万分之[5]计算。

第八条 合同的变更和解除

8.1 甲、乙、丙三方协商一致,可以变更或解除本合同。

8.2 发生下列情况之一时,甲、乙双方的任一方可以解除本合同。

(1) 由于不可抗力或不可归责于双方的原因致使本合同的目的无法实现的;

(2) 另一方丧失实际履约能力的;

(3) 另一方严重违约致使不能实现合同目的的;

(4) 另一方出现本合同第七条所述违约情形的。

8.3 变更或解除本合同均应采用书面形式。

第九条 管辖及争议解决方式

9.1 本合同的行为均适用中华人民共和国法律。

9.2 有关本合同的解释或履行,当事人之间发生争议的,应由各方协商解决;协商解决不成的,按下列第___种方式解决:(任选一种)

(1) 提交_____仲裁委员会仲裁;

(2) 依法向_____人民法院起诉。

第十条 合同的生效

10.1 本合同自甲、乙、丙三方的授权代表签字、盖章之日起生效。

第十一条 其他

11.1 甲、乙、丙三方对本合同内容的变更或补充应采用书面形式订立，并作为本合同的附件。本合同的附件与本合同具有同等的法律效力。

11.2 甲、乙双方在交易过程中依照要求递交的相关文件为本合同不可分割的组成部分，与本合同具有同等法律效力。

11.3 本合同一式六份，甲、乙双方各执二份，丙方留存二份备案用于定期清算和最终结算时使用。

(此页无正文)

(甲方) :
(盖章)

(乙方) :
(盖章)

法定代表人
或授权代表 (签字) :

法定代表人
或授权代表 (签字) :

日期： 年 月 日

日期： 年 月 日

(丙方) :
(盖章)

法定代表人
或授权代表 (签字) :

日期： 年 月 日