

场外衍生品交易确认书

(权益类互换交易)

(版本号：20190315)

甲方：中信证券股份有限公司

乙方：上海鸣石投资管理有限公司

甲方法定代表人或授权代表(签字或签章)：

乙方法定代表人或执行事务合伙人或授权代表

(签字或签章)：

或甲方公章或合同专用章：

或乙方公章或合同专用章：

甲方确认已对本确认书进行了及时、认真的检查，并确认本确认书的上述内容正确地反映了甲乙双方就本交易所达成的条款和条件。

乙方确认已对本确认书进行了及时、认真的检查，并确认本确认书的上述内容正确地反映了甲乙双方就本交易所达成的条款和条件。

日期：2020年07月27日

日期：2020年07月27日

为约定甲乙双方在下文指明的日期达成的交易的条款和条件，双方特签署本《场外衍生品交易确认书》(以下称“交易确认书”)。

本交易确认书适用于甲方和乙方于【2020-04-28】签署的主协议(编号：【SAC-5780】)、于【2020-04-28】签署的补充协议(编号：【SACS-5780-01】)及其补充，以及于【2020-04-28】签署的权益类互换交易定义文件(具体名称以实际签署为准，编号：【EQSWAP5780DEF20200428】，以下称“定义文件”)及其补充，旨在确认和证明双方已达成的交易的条款和交易要素，构成主协议中所称的“交易确认书”。

除本交易确认书另有约定外，本交易确认书所使用的术语释义、权益类互换交易的相关交易规则和条件适用主协议、补充协议及定义文件的相关约定。

本交易确认书一式【两】份，甲乙双方各留【一】份；本交易确认书的签署采用纸质方式的，经双方法定代表人或执行事务合伙人或授权代表签字或加盖公章或合同专用章后生效。本交易确认书的签署采用电子签名方式的，自甲乙双方以电子签名方式签署本交易确认书后生效；电子签名与在纸质交易确认书上手写签名或盖章具有同等法律效力，无须另行签署纸质交易确认书；双方通过电子签名方式产生的数据电文为本交易确认书的附件，是本交易确认书的有效组成部分，与本交易确认书具有同等法律效力。

一、 基本条款	
1.1 交易达成日	以本交易确认书附录一约定为准。
1.2 起始日	以本交易确认书附录一约定为准。
1.3 到期日	以本交易确认书附录一约定为准。
1.4 投资组合	构成投资组合的标的证券及其代码、标的的名义数量、标的期初价格、方向以本交易确认书附录一为准。
1.5 合约名义本金额	以本交易确认书附录一约定为准，以交易货币计价。
1.6 计算机构	甲方
1.7 交易对冲方	甲方
1.8 交易货币	以本交易确认书附录一约定为准。
1.9 结算货币	以本交易确认书附录一约定为准。
二、 权益收益金额条款	
2.1 组合待实现收益	在任何一个估值日，组合待实现收益 = 多头组合待实现收益+空头组合待实现收益，以交易货币计价。
2.2 组合当日实现收益	在任何一个估值日，组合当日实现收益 = 多头组合当日实现收益+空头组合当日实现收益，以交易货币计价。
2.3 权益收益计算日	在每一个估值日计算权益收益金额。
2.4 权益收益金额	在“权益收益计算日”计算的“组合当日实现收益”。
2.5 权益收益支付日	在每一个估值日支付权益收益金额。
2.6 权益收益金额支付方	甲方
2.7 权益收益金额接收方	乙方
2.8 权益收益支付	● 若权益收益金额 ≥ 0 ，则由权益收益金额支付方向权益收益金额接收方支付权益收

	<p>益金额，支付的权益收益金额结算增加预付金余额（增加金额以交易货币记账）；</p> <ul style="list-style-type: none"> 若权益收益金额<0，则由权益收益金额接收方向权益收益金额支付方支付权益收益金额的绝对值，支付的权益收益金额的绝对值结算扣减预付金余额（减少金额以交易货币记账）。
三、 利率收益金额条款	
3.1 约定利率	以本交易确认书附录一约定为准。
3.2 空头约定费率	以本交易确认书附录一约定为准。
3.3 基本费率	以本交易确认书附录一约定为准。
3.4 利率收益金额支付方	乙方
3.5 利率收益金额接收方	甲方
3.6 利率收益计算日	每年3、6、9、12月的15日、到期日或提前终止日。
3.7 利率收益支付日	利率收益计算日后3个营业日内。
3.8 利率收益金额	<p>在利率收益计算日，乙方应向甲方支付的利率收益金额 = 自起始日（含）至该利率收益计算日（含）的每个自然日利率收益金额之和 — 乙方已经支付的利率收益金额，以交易货币计价；</p> <p>其中，每个自然日的利率收益金额 = 基本费用 + 多头组合利率收益金额 + 空头组合利率收益金额。</p>
3.9 利率收益支付	利率收益金额支付方在利率收益支付日向利率收益接收方支付。
四、 声明	
<p>甲乙双方作出如下声明：</p> <p>（1）甲方没有义务持有标的来对冲本交易下的风险。甲方可以出于对冲与标的证券价格相关的风险需要而进行本交易下标的证券的买入或卖出操作。甲方可以自主决定开始、中止或终止任何对冲交易。且甲方享有与标的证券相关的任何权益，包括标的证券的所有权、收益权、投票权等。若甲方出于风险对冲需要而购买标的证券的，并不代表甲方是乙方的一致行动人，且甲方不会成为乙方的一致行动人。</p> <p>（2）乙方进行本交易并不代表乙方会名义或受益持有标的，且乙方不享有与标的证券相关的任何权益，包括投票权、所有权；但乙方作为甲方的交易对手，享与交易标的表现相关的本交易确认书明确规定的相关经济收益。</p> <p>（3）由于各种风险因素的存在，乙方理解其参与交易的目的不一定能够实现，上述后果由乙方自行承担，甲方对此不提供担保也不承担任何责任。</p> <p>（4）乙方如出现主协议、补充协议约定的违约事件，甲方有权提前终止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，乙方有义务承担由此产生的所有费用和损失。</p> <p>（5）若甲方根据乙方的指令，出于风险对冲的需要买入或卖出标的证券的，本协议中“市场买入价”和“市场卖出价”分别是指甲方直接或通过第三方对冲买入或对冲卖出标的证券的对冲成交价格。若甲方未根据乙方的指令实际买入或卖出标的证券的，本协议中“市场买入价”和“市场卖出价”分别是指参与标的证券所在交易所交易的普通券商，善意进行类似证券交易时在买入或卖出时所获得的合理的市场价格。其中普通券商是指在标的证券的交易所所在的国家及地区从事证券买卖业务，并受标的证券的交易所所在的国家及地区法律、法规（包括税收法律、法规）规管的任意券商。</p>	

场外衍生品交易确认书编号：EQSWAP5780DEF20200428-20200727

乙方：上海鸣石投资管理有限公司

主协议编号：SAC-5780

定义文件编号：EQSWAP5780DEF20200428

附录一：交易要素

一、基本要素

交易达成日	2020-07-27	起始日	2020-07-27
到期日	2025-07-26	合约名义本金额 (交易货币)	45,000,000.0
交易货币	人民币	结算货币	人民币
约定利率	6%/年	基本费率	0%/年
合约类型	风险管理类	空头标的约定费率计息基 准	“成本法”

二、投资组合

编号	标的证券	证券代码	标的期初价格 (交易货币)	标的的名义数量	合约乘数 (如有)	方向	约定费率
1	鸣石量化二十九号	SJX057	1.0721	41,973,696.48	1	多	0%