

场外衍生品交易平仓及结算确认书编号：EQSWAP5779DEF20200529-UN20200908  
乙方：上海鸣石投资管理有限公司【鸣石量化二十九号私募证券投资基金】  
主协议编号：SAC-5779  
定义文件编号：EQSWAP5779DEF20200529

场外衍生品交易平仓及结算确认书

(权益类互换交易平仓)  
(版本号：20190315)

甲方：中信证券股份有限公司  
甲方法定代表人或授权代表 (签字或签章):  
或甲方公章或合同专用章:  
日期：2020 年 09 月 08 日

乙方：上海鸣石投资管理有限公司【鸣石量化二十九号私募证券投资基金】  
乙方法定代表人/执行事务合伙人或授权代表 (签字或签章):  
或乙方公章或合同专用章:  
日期：2020 年 09 月 08 日

本《场外衍生品交易平仓及结算确认书》(以下简称“平仓及结算确认书”)适用于甲方和乙方于【2020-05-29】签署的主协议(编号:【SAC-5779】)、于【2020-05-29】签署的补充协议(编号:【SACS-5779-01】)及其补充, 以及于【2020-05-29】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:【EQSWAP5779DEF20200529】), 以下称“定义文件”)及其补充, 旨在确认和证明双方已平仓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”。

除本平仓及结算确认书另有约定外, 本平仓及结算确认书所使用的相关术语释义与本协议(本协议包括主协议、补充协议、定义文件和交易确认书)具有相同含义。本平仓及结算确认书约定与本协议约定不一致的, 以本平仓及结算确认书为准。本平仓及结算确认书未约定的, 适用本协议的相关约定。

本平仓及结算确认书一式【两】份, 甲乙双方各留【一】份。本平仓及结算确认书的签署采用纸质方式的, 经双方法定代表人/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。本平仓及结算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平仓及结算确认书后生效; 电子签名与在纸质平仓及结算确认书上手写签名或盖章具有同等法律效力, 无须另行签署纸质平仓及结算确认书; 双方通过电子签名方式产生的数据电文为本平仓及结算确认书的附件, 是本平仓及结算确认书的有效组成部分, 与本平仓及结算确认书具有同等法律效力。

如下互换合约平仓, 平仓结果如下 (交易货币 CNY):  
标的平仓明细:

交易确认书编号	交易方向	平仓确认日期	标的证券	证券代码	平仓前标的的名义数量	平仓成交数量	平仓后标的的名义数量	平仓成交金额 (交易货币)
EQSWAP5779DEF20200529-20200615	空	2020-09-08	中证 500	000905	-2, 674. 75569851	1, 234. 9471882	-1, 439. 80851031	8, 058, 153. 90

注: 若交易方向为“多”, 平仓后标的的名义数量=平仓前标的的名义数量-平仓成交数量; 若交易方向为“空”, 平仓后标的的名义数量=平仓前标的的名义数量+平仓成交数量

合约平仓信息汇总:

交易确认书编号	平仓确认日期	平仓后合约名义本金额 (交易货币)
EQSWAP5779DEF20200529-20200615	2020-09-08	8, 074, 430. 00

场外衍生品交易平仓及结算确认书编号：EQSWAP5779DEF20200529-UN20200908

乙方：上海鸣石投资管理有限公司【鸣石量化二十九号私募证券投资基金】

主协议编号：SAC-5779

定义文件编号：EQSWAP5779DEF20200529

---