**华泰证券场外衍生品交易确认书**

编号：HTSC-MSLH13-Q23

甲方：华泰证券股份有限公司

乙方：上海鸣石投资管理有限公司代鸣石量化十三号私募证券投资基金

根据双方订立的《中国证券期货市场衍生品交易主协议》、《中国证券期货市场衍生品交易主协议补充协议》之补充协议及《华泰证券场外衍生品交易履约担保协议》，甲乙双方特就本收益互换项目交易要素确认如下：

一、交易要素

|  |  |
| --- | --- |
| 名义本金金额 | 106,827,308.0元 |
| 名义本金币种 | 人民币 |
| 标的证券、代码  及数量 | |  |  |  | | --- | --- | --- | | 证券代码 | 证券简称 | 数量 | | IC2012 | 中证500指数期货2012 | 16,600.0 | |
| 约定利率 | 年化【4.74%】 |
| 利率收益金额 | 名义本金金额\*约定利率\*互换期限/365 |
| 互换起始日 | 2020/08/17 |
| 互换终止日 | 2020/12/17  若该日并非交易日，则顺延至下一交易日 |
| 互换期限：天 | 从互换起始日至互换到期日的自然日天数 |
| 权益收益金额 | ∑（期初基准价格-期末价格）\*数量 |
| 利率收益金额支付频率 | 到期支付 |
| 期初基准价格 | 【6,435.38】 |
| 期末价格 | 互换终止日甲方对冲本收益互换交易而买入标的证券的实际成交价格 |
| 期初交换金 | 名义本金金额\* 【66.6%】 |
| 收益支付结构 | 1、乙方支付利率收益金额给甲方  2、若权益收益金额为正，则甲方支付权益收益金额给乙方；若权益收益金额为负，则乙方支付权益收益金额绝对值给甲方。 |
| 其他要素 | 互换交易存续期间，甲方有权调整标的证券及其数量，具体以补充交易确认书为准。 |
| 备注 |  |

二、资金及履约保障品交割方式

针对权益类互换交易项下的期初交换金额交割，甲方于互换起始日之前，划转至乙方结算交割账户，账户信息确认如下：

账户名：华泰托管鸣石量化十三号私募证券投资基金

账  户：320006669018010221684

开户行：交通银行股份有限公司江苏省分行营业部

待交易到期后，根据实际交易情况进行净额轧差结算,甲方的结算交割账户如下：

账户名：华泰证券股份有限公司

账 户：506658190856

开户行：中国银行江苏省分行营业部

三、履约保障

（一）履约保障比例的计算

甲方将对乙方托管在甲方下属证券营业部的证券账户（以下称“乙方证券账户”）中的上述标的证券资产和现金资产采取限制转托管、限制取款、限制变更第三方存管银行、限制信用账户交易、限制利用标的证券再融资等措施，以保障本收益互换交易中乙方可能存在的支付义务的履行。

乙方履约保障比例的计算公式为

履约保障比例计算方为甲方。

（二）履约保障品的盯市规则

在每个交易日收盘后，甲方根据当日结算价对乙方所有合约的价值、履约保障品价值等进行清算，乙方愿意根据华泰证券以下规则追加或提取履约保障品：

交易存续期间，若履约保障比例一等于或小于【95%】时，或履约保障比例二连续【5】个交易日小于等于【80%】时，甲方有权向乙方发出《华泰证券场外衍生品交易追加履约担保通知书》（简称“追加履约担保通知书”），要求乙方及时采取甲方认可的履约担保措施。追保后，履约保障比例一应恢复至【100%】或以上，并且履约保障比例二应恢复至【85%】或以上。

乙方应当在甲方发出追加履约担保通知书之日的下一个工作日下午13:00以前及时采取甲方认可的履约担保措施。

如乙方未按上述要求采取经甲方认可的履约担保措施，甲方有权对乙方部分或所有交易进行强制提前终止，由此造成的一切损失和费用由乙方承担，并且甲方有权处置乙方已提供的履约担保品，在扣除相应损失金额和费用后，将剩余的资金（如有）退回乙方指定的账户。同时甲方有权对乙方证券账户采取限制措施，包括但不限于禁止股票买入、禁止股票卖出等。

（三）乙方证券账户投资限制

1. 单票权重2%，但前10大持仓股票豁免至5%

2. 单只股票持仓不得超过该股票最近30个交易日日均成交量的30%

3. 行业权重与中证500指数行业权重偏差不超过+/-7%，参考万得一级行业分类;

4. 股票市值/（标的市价\*数量）不高于105%或低于95%;

5.持有的A股股票不少于200只

如乙方未满足上述投资限制，甲方有权对乙方部分或所有交易进行强制提前终止，由此造成的一切损失和费用由乙方承担，并且甲方有权处置乙方已提供的履约担保品（包括但不限于乙方证券账户中的所有资产、乙方支付的追加预付金），在扣除相应损失金额和费用后，将剩余的资金（如有）退回乙方指定的账户。同时甲方有权对乙方证券账户采取限制措施，包括但不限于禁止股票买入、禁止股票卖出等。

（四）账面利润提取：

当履约保障比例大于【120%】时，乙方有权提取证券账户中的现金部分，提取后的履约保障比例不得低于【120%】。

（五）在收益互换存续期间，如乙方拟提前终止本交易，须获得甲方事先书面同意，否则不能单方提前终止。

四、异常情况及其处理

1、挂钩标的涨跌停

如因挂钩标的涨跌停影响乙方的履约担保能力，导致乙方出现履约保障不足时，乙方应按照履约担保协议约定及时追加合格履约担保品。如起始日起遇挂钩标的涨跌停或连续涨跌停，导致无法执行初始交易的，则由甲乙双方重新协商确定初始交易方案。

2、挂钩标的停牌

挂钩标的发生停牌事件的，双方同意按以下方式处理：如起始日停牌，双方需重新进行协商，以确定新的起始日；若互换交易期间停牌，不影响交易的继续履行，不做特别处理；若双方约定的到期日挂钩标的处于停牌状态，则到期日自动延长至挂钩标的复牌日之后第4个交易日。利率收益金额计算按照延期后的互换期限进行计算。期末价格则按照双方约定的方式确定。

3、挂钩标的ST、\*ST处理

若挂钩标的被ST或\*ST处理，不符合挂钩标的筛选标准的，甲方不再接受以该证券为挂钩标的的交易，但已经达成的互换交易可以继续。

4、挂钩标的暂停或终止上市

互换交易到期日前，若挂钩标的发生暂停或终止上市，甲乙双方将终止以该证券为挂钩标的的所有互换交易，并协商确定期末价格。

5、违约事件、终止事件

违约事件、终止事件的处理，根据主协议及其补充协议的约定处理。针对本交易，未经甲方事先书面同意，乙方不得允许其客户撤回或提取部分或全部委托资产，否则构成乙方在本交易确认书下的一项违约事件。

6、其他特殊情况

对于除上述情况以外的其他异常情况，甲方将根据实际情形与乙方通过协商达成一致处理意见。

五、风险揭示

除《华泰证券场外衍生品交易风险揭示书》揭示的风险外，本交易可能还存在以下特有风险：

1、由于证券被调出挂钩标的范围、履约保障比例低于追保线等原因导致挂钩标的被强行减仓或强行平仓的风险。

2、由于乙方出现本协议约定的违约事件或终止事件或不能按时足额偿还因本交易而对甲方产生的相关债务，导致甲方提前终止交易，履约保障品被甲方依本协议约定进行处置的风险。

3、由于乙方交易指令存在违法违规行为，导致交易行为受到外部行政处罚、监管意见、交易所警示，并承担相关责任的风险。

乙方确认对本协议项下交易的风险具有充分的认识。由于各种风险因素的存在，乙方所预期的规避风险、保值、获利等交易目标不一定能够实现，甚至可能发生严重亏损，而上述后果、风险和损失应由乙方自行承担，甲方对此不提供承诺也不承担任何责任。

六、声明

（一）合规性声明

乙方保证：国家有关法律、法规、规章未禁止乙方办理此笔交易，乙方办理该笔交易符合国家有关法律法规以及监管/主管部门的有关规定（包括但不限于私募证券投资基金投资管理、私募证券投资基金参与场外衍生品交易、投资者适当性等相关规定），并承诺不从事属于证券交易所和证券监管机构认定的以下可能严重影响证券交易秩序的异常交易、证券市场操纵、内幕交易（以下统称异常交易）行为，否则将可能因此受到相应监管措施：

1、可能对证券交易价格产生重大影响的信息披露前，大量或持续买入或者卖出相关证券；

2、单个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户之间，大量或者频繁进行反向交易；

3、单独或合谋，以涨幅或跌幅限制的价格大额申报或连续申报，致使该证券交易价格达到或维持涨幅或跌幅限制；

4、单个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户，大笔申报、连续申报、密集申报或申报价格明显偏离该证券行情揭示的最新成交价；

5、频繁申报和撤销申报，或大额申报后撤销申报，以影响证券交易价格或误导其他投资者；

6、集合竞价期间以明显高于前收盘价的价格申报买入后又撤销申报，随后申报卖出该证券，或以明显低于前收盘价的价格申报卖出后又撤销申报，随后申报买入该证券；

7、对单一证券品种在一段时期内进行大量且连续交易；

8、同一证券账户、同一证券公司或同一证券营业部的客户大量或者频繁进行日内回转交易；

9、大量或者频繁进行高买低卖交易；

10、在证券价格敏感期内，通过异常申报，影响相关证券或其衍生品的交易价格、结算价格或参考价值；

11、单独或合谋，在公开发布投资分析、预测或建议前买入或卖出有关证券，或进行与自身公开发布的投资分析、预测或建议相背离的证券交易；

12、在大宗交易中进行虚假或其他扰乱市场秩序的申报；

13、证券交易所、证券监管机构认为需要重点监控的其他异常交易行为。

如果在交易期限内乙方的上述保证失效，甲方有权终止交易并要求乙方对证券账户中所有资产强行平盘；强行平盘所有费用和损失以及由乙方保证失效引起的其他损失皆由乙方承担。

（二）签署人员授权声明

签署此交易确认书及相关文本的人员均具有有效授权。

（三）风险承受能力声明

1.乙方确认，甲方已就本交易的各种风险因素（包括但不限于信用风险、市场风险、流动性风险、操作风险、法律风险等）向乙方作出了充分详细的披露和解释。经自主和独立判断，乙方已经完全理解该笔交易的条款和各种隐含风险，明确办理此笔交易对乙方的法律、税务和财务会计影响，并确认办理此笔交易符合乙方的交易目的。

2.乙方已了解该笔交易的最差情况及最大潜在亏损，并对此具有足够的承受能力。乙方保证不以潜在风险为理由拖延或拒绝履行本交易项下的各项义务。

（四）其他声明

1、权益类收益互换交易涉及法定信息披露义务的，乙方须按照规定履行信息披露义务。

2、交易存续期间，甲方将每日对交易头寸进行市值重估，重估价格价格参考当日期货盯市价格。当乙方交易的履约保障比例低于追保线时，乙方有义务在接到甲方追保通知规定的时间内向甲方足额追加履约保障品。

乙方如出现主协议、补充协议及担保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。提前终止价格参考终止日的中证500指数期货盯市价格。

3、乙方保证发出的指令内容是合法合规的，且不得利用本交易从事规避法律法规相关要求及强制性规定的违规行为,包括但不限于：利用本交易进行股票分仓以规避相关信息披露、交易限制等规定，利用本交易影响或拉抬股价，或乙方指令涉及内幕交易或操纵市场、交易涉嫌洗钱、恐怖融资、利益输送等情形。乙方违反上述声明的，甲方将有权单方终止交易，由此导致的监管处罚和法律责任及所有费用和损失均由乙方或乙方管理的产品承担。

4、乙方应当在收到《交易确认书》后5个工作日内将其签署后的《交易确认书》的两份原件，根据收益互换交易协议约定以专人递送、挂号平信邮寄或特快专递的方式向甲方发出。乙方未能发送或甲方未能收到上述原件并不影响交易的达成和生效。

（以下无正文）

甲方： 乙方：

日期：2020/08/17 日期：2020/08/17