**场外衍生品交易确认书**

（挂钩利率期货互换交易）

编号【CNTRID】

|  |  |
| --- | --- |
| 甲方：中信证券股份有限公司 | 乙方：CLIENT |
| **甲方法定代表人或授权代表（签字或签章）：** | **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：**SIGN\_DATE | **日期：**SIGN\_DATE |

甲方和乙方以下单独称“交易一方”，合称“交易双方”。交易双方已签署了《MAIN\_CNTR\_NAME》（以下称“主协议”）（合同编号：【MAIN\_CONTRACT\_ID】）及补充协议（以下称“补充协议”）以及《场外衍生品互换交易(挂钩利率期货)定义文件》（以下称“定义文件”）。本确认书构成主协议下的一项“交易有效约定”，主协议、补充协议和定义文件中的全部条款适用于本确认书，除非本确认书另有约定。

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。

|  |  |
| --- | --- |
| 基本条款 | |
| * 1. 交易达成日 | 以本交易确认书附录一约定为准。 |
| * 1. 起始日 | 以本交易确认书附录一约定为准。 |
| * 1. 到期日 | 以本交易确认书附录一约定为准。 |
| * 1. 最后平仓日 | |  |  | | --- | --- | | 标的合约名称 | 最后平仓日 | | 美债两年期货合约(2-Year US Treasury Note Futures) | 标的合约第一通知日前2个营业日 | | 美债五年期货合约(5-Year US Treasury Note Futures) | 标的合约第一通知日前2个营业日 | | 美债十年期货合约（10-Year US Treasury Note Futures） | 标的合约第一通知日前2个营业日 | | 美债超十年期货合约(Ultra 10-Year US Treasury Note Futures) | 标的合约第一通知日前2个营业日 | | 美债长期期货合约（U.S. Treasury Long Bond Futures） | 标的合约第一通知日前2个营业日 | | 美债超长期期货合约(CME Ultra Long Term U.S. Treasury Bond Futures) | 标的合约第一通知日前2个营业日 |   若标的合约非上述所列标的，则最后平仓日以《定义文件》为准。 |
| * 1. 投资组合 | 构成投资组合的标的及其代码、标的名义数量、标的期初价格、方向、合约乘数以本交易确认书附录一为准。 |
| * 1. 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. 计算机构 | 甲方 |
| * 1. 交易对冲方 | 甲方 |
| * 1. 交易货币 | 以本交易确认书附录一约定为准。 |
| * 1. 结算货币 | 以本交易确认书附录一约定为准。 |
| 浮动收益金额条款 | |
| * 1. 浮动收益计算日 | 以《定义文件》为准。 |
| * 1. 浮动收益金额 | 以《定义文件》为准。浮动收益金额以交易货币计价，按照浮动收益支付日当日汇率折算为人民币进行结算交收。 |
| * 1. 浮动收益支付日 | 同浮动收益计算日 |
| * 1. 浮动收益金额支付方 | 甲方 |
| * 1. 浮动收益金额接收方 | 乙方 |
| * 1. 浮动收益支付 | * 若浮动收益金额≥0，则按照浮动收益支付日汇率，由浮动收益金额支付方向浮动收益金额接收方支付换算为人民币的浮动收益金额； * 若浮动收益金额<0，则按照浮动收益支付日汇率，由浮动收益金额接收方向浮动收益金额支付方支付换算为人民币的浮动收益金额的绝对值。 * 浮动收益支付的结算通过增加或减少乙方对应交易货币的预付金（增加或扣减的金额为按照浮动收益支付日汇率将对应浮动收益金额换算为人民币的金额）实现。 |
| 利率收益金额条款 | |
| * 1. 基本费率 | 以本交易确认书附录一约定为准。 |
| * 1. 利率收益金额支付方 | 乙方 |
| * 1. 利率收益金额接收方 | 甲方 |
| * 1. 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。 |
| * 1. 利率收益支付日 | 利率收益计算日后3个营业日内。 |
| * 1. 利率收益金额 | 以《定义文件》为准。 |
| * 1. 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。利率收益金额按照交易货币计算，按照利率收益支付日当日汇率折算为人民币进行结算交收。 |
| 声明 | |
| 甲乙双方作出如下声明：  乙方保证：中国有关法律、法规、规章未禁止乙方办理本交易确认书项下交易，乙方办理本交易确认书项下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，并已经获得办理该交易的相关授权。乙方参与主协议、补充协议、交易确认书项下收益互换合约交易所涉及资金、资产来源合法。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。  乙方保证与甲方本收益互换交易，是基于资产配置、产品投资、风险管理的真实需求，不涉及违规资产出表、资金腾挪或者规避信息披露、投资范围、交易限制、杠杆约束等规避监管要求的情形，不存在通过互联网、自媒体向不特定公众宣传或通过不当宣传诱导不适格投资者参与场外期权交易的情形，未从事配资公司、荐股平台、P2P 平台、违规互联网金融平台等涉嫌非法金融活动或存在潜在利益冲突的情形。乙方承诺已按照甲方尽职调查要求提供真实信息资料，符合《证券期货投资者适当性管理办法》规定标准的专业机构投资者。  乙方承诺严格遵守有关国际及国内反洗钱、反恐怖融资、反逃税等法律法规；配合并接受甲方反洗钱、反恐怖融资、反逃税与制裁合规工作的相关调查或审查，如实提供甲方要求的相关信息与资料，配合甲方采取相应管控措施。乙方承诺自行承担因违反国际或国内反洗钱、反恐怖融资、反逃税与制裁合规法律法规等产生的不利后果，由此给甲方造成损失的（包括但不限于经济损失、行政处罚等），乙方应予赔偿。  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价格相关的风险需要而进行本交易下标的的买入或卖出操作。甲方可以自主决定开始、中止或终止任何对冲交易，且甲方享有与标的相关的任何权益。若甲方出于风险对冲需要而购买标的的，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。  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，享有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。  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。  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。  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的，本协议中“市场买入价”和“市场卖出价”分别是指参与标的所在交易所交易的普通券商，善意进行类似标的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的交易所所在的国家及地区从事证券期货买卖业务，并受标的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。  甲方为对冲本交易确认书项下交易或参考标的所涉的价格相关风险，将寻求第三方做相应的对冲安排。如甲方或向甲方提供对冲安排的第三方因可适用的法律、法规、监管规则及其相关解释及适用（包括但不限于中国境内、标的合约交易所所在地、甲方的对冲交易对手的所在地和对冲地）的变化或不可抗力、政府行为等其他事件的发生（或甲方按照自身合理判断认为即将发生前述事件）或甲方依据与第三方的相关合同条款约定导致上述对冲安排变为不可能、不可行、对冲停止或对冲安排提前终止，甲方有权提前终止本交易确认书项下的交易或经乙方同意修改本交易确认书项下的交易结构、相应调整费率。若提前终止，提前终止价格由甲方本着商业合理原则确定。  甲乙双方均清楚并承诺会严格遵守《刑法》、《反不正当竞争法》、《证券法》、《公司法》等有关反商业贿赂和商业犯罪相关的法律法规，承诺本方、本方工作人员或其他利益关系人不得向对方、对方工作人员或其他利益关系人索要、收受、提供、给予协议约定外的任何物质或者非物质利益，包括但不限于明扣、暗扣、现金、房产、股权、支付凭证（如购物卡、消费卡、提货券等）、实物、有价证券、旅游、宴请、赞助、工作安排等，或为上述行为提供代持等便利。任何一方违反上述条款之规定，给对方造成损失的，应承担损害赔偿责任。涉嫌犯罪的，移交司法机关追究法律责任。  如果在交易期限内一方违反上述声明，守约方有权单方提前终止本交易；提前终止所有费用和损失以及其他由违反保证或保证失效引起的其他所有费用及损失皆由违反方承担。  **甲方免责声明：**  甲方仅对乙方下达的指令进行形式审核，不对乙方的实际交易意图及行为后果承担任何法律责任，且在乙方出现不当行为时，甲方有权提前终止本交易，提前终止所有费用和损失由乙方承担。  乙方的不当行为包括但不限于：  （1）乙方单独或与他人合谋通过本交易方式或与其他方式配合进行市场操纵等扰乱金融市场的行为；  （2）乙方单独或与他人合谋利用内幕信息或价格敏感信息通过本交易方式或与其他方式配合进行内幕交易的行为；  （3）乙方单独或与他人合谋通过本交易方式或与其他方式配合进行利益输送、利用信息优势谋取不正当利益的行为；  （4）其他法律、法规、监管规定、自律规则以及监管机构认为属于不正当的交易行为，或涉嫌违反有关法律、法规、监管规定、自律规则的行为。 | |

## 附录一：交易要素

**一、基本要素**

|  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- |
| 交易达成日 | TRADE\_DEAL\_DATE | 起始日 | TRADE\_ORDER\_DATE |
| 到期日 | TRADE\_FINISH\_DATE | 合约名义本金额  (交易货币) | NOTIONAL\_AMT\_TOTAL |
| 交易货币 | PAYOFFCCY | 结算货币 | CNY |
| 基本费率 | FEE\_RATE%/年 |  |  |

**二、投资组合**

|  |  |  |  |  |  |  |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- | --- |
| 编号 | 标的合约 | 标的代码 | 标的期初价格  （交易货币） | 标的名义数量 | 合约乘数 | 方向 |
| 1 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 2 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 3 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 4 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 5 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 6 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 7 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 8 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 9 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 10 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |
| 11 | I\_NAME | I\_CODE | AVGCOST | DEACOUNT | MULTIPLIER | TRADE\_TYPE |