信达证券股份有限公司

收益互换交易结算终止通知书

编号：{{id}}

尊敬的客户：{{customer}}

根据贵司（“甲方”）与我司（“乙方”）签署的《中国证券期货市场衍生品交易主协议》（协议编号：【{{main\_id}}】,以下称“主协议”）、《中国证券期货市场衍生品交易主协议补充协议》（协议编号：【{{sup\_id}}】,以下称“补充协议”）和《信达证券股份有限公司收益互换交易确认书》（协议编号：【{{confirm\_id}}】,以下称“交易确认书”）及《收益互换终止交易意向书》（协议编号：【{{intent\_id1}}】、【intent\_id2】）内容，该笔交易于【{{end\_date\_myd}}】部分提前终止。经计算，我司应向您支付的终止交易净额为【 {{end\_amt}} 】元。具体要素如下：

|  |  |
| --- | --- |
| 标的 | {{target\_name}}（{{target\_id}}） |
| 本次终止交易数量（股） | {{stop\_num}} |
| 初始交易日期 | {{start\_date}} |
| 初始交易价格（元/股） | {{start\_price}} |
| 终止交易日期 | {{end\_date}} |
| 终止交易价格（元/股） | {{end\_price}} |
| 终止交易部分合格履约保障品金额（元） | {{end\_pro\_amt}} |
| 浮动收益金额（元） | {{flo\_inc\_amt}} |
| 待支付固定收益金额（元） | {{pre\_stat\_inc\_amt}} |
| 终止交易净额（元） | {{end\_amt}} |

注：

1、待支付固定收益金额计算期间为{{end\_date\_myd}}至{{end\_date\_myd}}

2、终止交易净额=终止交易部分合格履约保障品金额+浮动收益金额-待支付固定收益金额

烦请贵司于2020年9月10日11时前确认以上终止交易净额并邮件回复，如无异议（未于2020年9月10日11时前回复此邮件视为无异议），我司将向您以下账户支付【{{end\_amt}}】元

户名：【{{customer}}】

开户行：【{{bank}}】

账号：【{{account}}】

特此通知。

信达证券股份有限公司

2020 年9月9日