

海通证券股份有限公司

深交所质押式报价回购交易风险揭示书



二〇二一年八月

尊敬的客户：

质押式报价回购交易（以下简称“报价回购交易”）业务中具有市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、政策风险及其他各类风险。为了使您充分了解报价回购交易中存在的各类风险，根据有关法律、行政法规、规章、规则、暂行办法，特提供本风险揭示书，请您认真详细阅读。报价回购交易存在的风险包括但不限于以下内容：

1) 客户在办理报价回购交易前，应对自身参与的适当性、合法性进行审慎评估，并以真实身份参与。客户应根据自身财务状况、实际需求、风险承受能力以及内部管理要求（若为机构客户）等，慎重考虑是否适宜参与报价回购交易，避免因不当参与而产生损失。

2) 客户在参与报价回购交易前，应了解海通证券是否已获得深交所同意并开通报价回购交易权限。

3) 在报价回购交易中，海通证券既是客户的交易对手方，又根据客户委托代为办理有关交易、登记结算等事宜，可能由此带来利益冲突风险。

4) 在报价回购交易中，可能出现因资金不足、系统故障等导致T+1日（T为交易日）资金划付失败，需要将相应的资金划付延迟至T+2日所带来的风险。如果T+2日仍无法完成资金划付，则属于违约，违约方按《海通证券股份有限公司深交所质押式报价回购交易客户协议》（以下简称“《客户协议》”）的约定承担违约责任。

5) 报价回购交易全部质押物设定的质权由海通证券所有报价回购未到期以及购回交易未完成资金划付的客户共同享有, 客户所享有的质权不对应具体质押物品种和数量, 客户不得单独就质押物主张行使质权。当海通证券违约时, 全体质权人可以共同行使质权。质押物处置所得由客户按债权比例公平受偿。处置后质押物有剩余的归海通证券所有。

6) 客户应关注报价回购交易中可能面临的信用风险, 以及由此可能造成的损失, 包括但不限于因海通证券原因导致证券或资金划付失败, 因质押物价值波动、折算率调整、司法冻结或扣划等导致质押物不能足额担保所有报价回购债务, 以及海通证券被暂停或终止报价回购交易权限、进入风险处置或破产程序等。因海通证券原因导致资金划付失败而造成客户无法按约收到应收资金的, 每延迟一天海通证券按延迟交付金额的万分之三向客户另行支付违约金。除此之外, 海通证券无需向客户另行支付其他形式的补偿、赔偿或违约金等。

7) 如果海通证券报价回购交易权限被终止, 将首先根据《客户协议》的约定, 权限终止当日, 所有未到期报价回购交易全部提前到期, 回购价格为提前购回报价。海通证券依据《客户协议》及时对质押券进行处置, 并由其将处置所得与担保资金之和按债权比例优先向客户公平清偿。仅当海通证券怠于、不当或无法处置时, 由《客户协议》约定委托的第三方按照价格公允、快速处置的原则对质押券进行处置, 处置所得与担保资金之和按债权比例优先向客户公平清偿。

8) 报价回购质押物包括债券、现金、基金份额、深交所和中国结算认可的其他证券等。客户应关注《客户协议》中对质押物选择与担保价值计算依据的约定，由此带来的损失或风险由客户自行承担。

9) 报价回购初始交易的申报价格和提前购回价格由海通证券通过官方网站或系统或营业场所公布，客户初始交易或初始委托申报成功即视为同意并接受该收益。若市场发生变化，已达成的收益不会进行相应调整，客户可能面临无法获取更高收益的风险。

10) 若T日提前购回金额(不包含当日买入后当日即提前购回的委托)占T日未到期报价回购交易的比例超过巨额比例限制的，或者T日单个交易品种提前购回金额(不包含当日买入后当日即提前购回的委托)占T日该交易品种未到期报价回购交易的比例超过巨额比例限制的，或者客户提前购回金额(不包含当日买入后当日即提前购回的委托)超过单客户巨额提前购回限额的，海通证券有权根据《客户协议》的约定拒绝相应的任何导致上述情况发生的委托，可能影响客户的资金使用安排。海通证券有权根据实际业务情况设置或更改巨额提前购回比例限制、巨额提前购回限额/单客户巨额提前购回限额等，但需及时进行公告或展示，公告或展示平台为海通证券官方网站或系统或营业场所。但若海通证券认为其有能力偿付巨额赎回情况下的客户本金及收益，则海通证券可接受客户的提前购回委托。

11) 所有交易和功能在下单后均不能撤销。客户如因失误导致提交委托，无法通过撤单方式取消，可能会影响客户的资金使用安排和

流动性。

12) 客户应关注报价回购交易中可能存在的操作风险，以及由此可能造成的损失，包括但不限于因海通证券原因交易不能按期达成、因通讯失效而不能及时送达相关信息，以及因客户原因没有及时了解相关通知信息等。

13) 在报价回购交易存续期间，海通证券将根据《客户协议》约定的通知与送达方式以及通讯地址，向客户发送通知。通知发出即视作海通证券已经履行对客户的通知义务。客户无论因何种原因没有及时知晓通知内容，由此产生风险和损失由客户自行承担。

14) 在报价回购交易存续期间，客户联系方式发生变化，但未在变更之日起两个交易日内书面通知海通证券，由此产生的风险和损失由客户自行承担。

15) 在报价回购交易过程中，客户应关注报价回购交易中面临的因海通证券、深交所或中国结算的技术系统故障或差错所带来的风险，以及由此可能造成的损失。

16) 客户应关注证券账户、身份证件和交易密码等资料的安全，如因客户证券账户、身份证件和交易密码保管不当造成损失的，由客户自行承担全部经济损失和法律后果。

17) 客户应关注因法律法规、相关政策和规则的变化、修改等原因，可能带来的风险。

18) 海通证券有权根据报价回购交易的相关制度规定及《海通证券股份有限公司深交所质押式报价回购交易业务投资者适当性管理办法》对客户的适当性进行持续性审查，当客户的适当性不匹配时，海通证券有权终止客户的报价回购交易权限。

19) 客户应关注因火灾、地震、瘟疫、社会动乱、特殊天气等不能预见、不能避免或不能克服的不可抗力情形，可能带来的风险。

20) 因报价回购交易或《客户协议》执行产生的任何争议、纠纷，由客户与海通证券双方协商或通过约定的争议处理方式解决，与任何第三方无关，客户无权向任何第三方主张权利或追究责任。

本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明报价回购交易的所有风险。客户在参与报价回购交易前，应认真阅读相关业务规则及协议条款，对报价回购交易所特有的业务规则必须有所了解和掌握，并确信已做好足够的风险评估与财务安排，有足够的风险承受能力，避免因参与报价回购交易而遭受难以承受的损失。

本人确认,海通证券已经向甲方讲解报价回购业务规则和本风险揭示书内容,提示并详细说明报价回购业务的风险,知悉海通证券不保证甲方获得投资收益或承担甲方投资损失。

本人确认,已经认真阅读并全面接受本风险揭示书全部条款,已充分知悉、理解本风险揭示书中所提示的风险及其后果,自愿参与报价回购交易并自行承担由此产生的风险和法律后果。

海通证券股份有限公司
深交所质押式报价回购交易客户协议



二〇二一年八月

海通证券股份有限公司深交所质押式报价回购交易客户协议

甲方（投资者）：

乙方：海通证券股份有限公司

为了规范甲乙双方开展质押式报价回购交易（以下简称报价回购），明确甲乙双方在开展报价回购交易的权利、义务关系，根据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国民法典》、《证券登记结算管理办法》、《中国证券登记结算有限责任公司证券登记规则》、《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》、《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》（以下简称“《业务办法》”）和其他有关法律法规，在平等自愿、诚实信用的基础上，就甲乙双方开展报价回购的相关事宜，达成《质押式报价回购交易客户协议》（以下简称“本协议”），供甲乙双方共同遵守。

第一章 释义和定义

第一条 除非本协议另有解释或说明，下列词语或简称具有以下含义：

（一）报价回购交易：是指乙方将符合《业务办法》规定的自有资产作为质押物，以质押物折算后的标准券数量所对应金额作为融资的额度，通过报价方式向甲方融入资金，同时约定乙方在到期购回

日向甲方返还融入资金、支付相应收益的交易。乙方可以提交以下自有资产作为质押物：符合深交所债券质押式回购交易相关规定的债券、基金份额、现金、深交所和中国结算认可的其他证券。

（二）标准券折算率：是指根据深交所及中国结算深圳分公司的相关规定及本协议的约定，将质押物折算为标准券的折算比例。

（三）初始交易的申报价格：是指百元资金到期购回年收益，最小变动单位为人民币 0.001 元。

（四）提前购回价格：是指百元资金提前购回年收益，最小变动单位为人民币 0.001 元。

（五）提前购回：是指甲乙双方根据本协议的约定，在报价回购到期日之前进行购回交易。

（六）交易日：是指报价回购交易发生的日期。

（七）到期购回：是指甲乙双方根据本协议的约定，在报价回购到期日进行购回交易。

（八）自动续做：是指将报价回购交易到期后下一期交易的达成方式约定为自动方式。甲方在约定的日期前不发出终止续做指令，则视为同意按照相同的交易品种、委托金额、乙方每一到期日公布的报价，自动达成下一期交易。

（九）手动续做：是指将报价回购交易到期后下一期交易的达成方式约定为手动方式。甲乙双方约定为手动方式的，甲方在到期购回日希望继续参与下一期交易的，应当再次向乙方发出初始委托。

(十) 不再续做：在自动续做期间，甲方发出不再续做委托指令，终止自动续做功能，允许部分不再续做。

(十一) 证券交易所：是指深圳证券交易所。

(十二) 证券登记结算公司：是指中国证券登记结算有限责任公司及其分公司。

(十三) 交易日：是指报价回购交易发生的日期。

(十四) 交易时间：是指每个交易日的 9：15 至 11：30，13：00 至 15：30。

(十五) 天、天数：非特别申明为交易日的均指日历天数。

(十六) 申报数量：报价回购交易的申报数量单位为张，1 张为人民币 100 元；初始交易最低申报数量为 10 张，超出部分应当为 10 张的整数倍；提前购回交易最低申报数量为 1 张，超出部分应当为 1 张的整数倍。申报数量乘以每张价格（100 元）为申报金额。

(十七) 交易品种：是指按照期限进行划分的报价回购交易品种，交易品种的期限为一年以内，具体交易品种的期限由乙方在乙方公司网站或系统或营业场所公布。

第二章 声明和保证

第二条 甲方向乙方作如下声明和保证：

(一) 甲方具有相应的报价回购交易主体资格，不存在法律、行政法规、部门规章及其他规范性文件等禁止、限制或不适于参与报价回购交易的情形。

(二) 甲方自愿遵守报价回购交易有关的法律法规、部门规章、交易和结算规则等规定，以及乙方指定的相关业务规定。

(三) 甲方用于报价回购交易的资产（包括资金和证券，下同）来源和用途合法，并保证自愿遵守国家反洗钱的相关规定。

(四) 甲方已仔细阅读客户协议、《海通证券股份有限公司深交所质押式报价回购交易风险揭示书》（以下简称“《风险揭示书》”）

《海通证券质押式报价回购交易产品资料概览》（见附件一，以下简称“《产品资料概览》”）的所有条款、内容以及《业务办法》的规定，听取了乙方对报价回购交易相关规则、客户协议、《风险揭示书》、《产品资料概览》内容的充分说明，准确理解客户协议及《风险揭示书》的确切涵义，特别是甲方的责任条款和乙方免责条款的涵义，清楚认识并愿意承担报价回购交易涉及的相关风险，愿意接受客户协议的约束。

(五) 甲方承诺以真实身份参与报价回购交易，保证签署客户协议时及客户协议存续期间向乙方披露或提供的信息和资料真实、准确、完整。

(六) 甲方承诺在本协议期内维持上述声明，并保证其真实有效。

(七) 甲方承诺未经乙方书面同意，不以任何方式转让本协议项下的各项权利与义务。

第三条 乙方向甲方做如下声明和保证：

(一) 乙方是依法设立的证券经营机构，经中国证监会同意开展报价回购交易，并经深交所开通了报价回购交易权限，且该交易权限并未被暂停或终止。

(二) 乙方自愿遵守报价回购交易有关的法律法规、部门规章、交易和结算规则等规定，以及乙方指定的相关业务规定。

(三) 乙方用于报价回购交易的资产（包括资金和证券，下同）来源和用途合法，并保证自愿遵守国家反洗钱的相关规定。

(四) 乙方具有开展报价回购交易的必要条件，能够为甲方进行报价回购交易提供相应的服务。

(五) 乙方承诺在客户协议期间内维持上述声明，并保证其真实有效。

第三章 报价回购交易一般性约定

第四条 乙方向深交所提交的报价回购交易申报，均视为基于双方真实交易意愿的申报。乙方未经甲方同意进行交易申报的，应承担全部法律责任，并赔偿由此给甲方造成的损失，但已达成的交易结果不得改变。

第五条 深交所和中国结算深圳分公司对乙方提交的交易申报中各要素的真实性、准确性不进行实质性检查，不承担因申报要素不真实、不准确产生的损失。

第六条 交易双方一致同意，甲方资金不足的将无法参与报价回购交易。

第七条 甲方已充分理解并同意，在报价回购交易中，乙方是甲方回购交易对手方，同时又代甲方办理委托申报，并负责办理资金结算等事宜。

第四章 双方的权利义务

第八条 甲方的权利和义务

（一）甲方享有如下权利：

- 1、有权查询与其报价回购交易相关的信息。
- 2、有权按客户协议约定申请提前购回。
- 3、有权按客户协议约定申请不再续做。
- 4、有权获取报价回购收益。
- 5、相关法律、法规、规范性文件、业务规则规定及本协议约定的其他权利。

（二）甲方承担如下义务：

- 1、按照乙方要求如实提供身份证明资料和信用状况证明文件，并对所提交的各类文件、资料、信息的真实性、准确性、完整性和合法性负责。在上述相关文件、资料、信息等发生变更时，及时通知乙方；
- 2、甲方进行报价回购初始委托时应保证其资金账户中有足够的资金，根据成交结果承担相应的清算交收责任。
- 3、甲方在参与报价回购交易期间，不得撤销与乙方的托管关系，不得进行销户等操作。

4、甲方应妥善保管证券账户、身份证件、交易密码等资料、信息，不得将证券账户、身份证件、交易密码出借给他人，或全权委托乙方员工、证券经纪人操作账户，否则，由此产生的后果由甲方自行承担；

5、甲方承诺所有通过甲方交易密码办理的业务均视为甲方真实意思的表示，甲方对此承担全部责任；

6、相关法律、法规、规范性文件、业务规则规定及本协议约定的其他义务。

第九条 乙方的权利和义务

（一）乙方享有如下权利：

1、有权拒绝可能导致可用额度超限的委托或其他指令，有权拒绝非交易时间的委托，并有权在乙方报价回购业务权限暂停期间拒绝接受初始交易委托。乙方报价回购业务权限暂停期间有权拒绝接受提前购回委托。

2、当质押物经折算后的标准券数量所对应金额超过乙方所担保的全部报价回购交易金额的，乙方可以向中国结算深圳分公司申请将超出部分的质押券转出质押库，或者申请将超出部分的担保资金转出担保资金账户。

3、对于巨额提前购回或巨额不再续做，甲方应按约定进行提前预约，否则，乙方有权拒绝甲方的申请。

4、交易存续期内，乙方有权拒绝甲方撤销与乙方的托管关系，销户等操作申请。

5、相关法律、法规、规范性文件、业务规则规定及本协议约定的其他权利。

(二) 乙方承担如下义务：

1、除客户协议另有约定外，及时、准确的执行甲方的委托指令。
2、按时对报价回购交易进行购回清算，并依约向甲方支付收益。
3、如实记载甲方报价回购交易情况，受理甲方提出的查询申请，向其提供查询服务。

4、遵守报价回购额度控制的相关规定。

5、相关法律、法规、规范性文件、业务规则规定及本协议约定的其他义务。

第五章 客户适当性管理

第十条 甲方报价回购业务申请

甲方申请进行报价回购交易的，应具备以下条件：（1）甲方账户为实名制合法开户，开户资料真实完整；（2）甲方须与乙方签署本协议以及《质押式报价回购交易风险揭示书》；（3）甲方的交易结算资金已经纳入第三方存管；（4）乙方规定的其他必要条件。

第十一条 经乙方审查，甲方存在下列情况之一的，乙方有权拒绝受理甲方的报价回购交易申请：

（一）《质押式报价回购交易客户协议》《质押式报价回购交易风险揭示书》填写错误或未有效签署的；

(二) 涉及刑事诉讼或重大民事诉讼的或存在司法机关冻结等情形;

(三) 其他违反有关法律、法规、规章、规则等规定、乙方制定的相关业务规定或本协议有关条款约定的。

第六章 质押物与质权

第十二条 质押物与质权

(一) 乙方提交的作为报价回购交易质押物的自有证券应转入中国结算深圳分公司设立的报价回购交易质押券保管库。乙方提交的充当报价回购交易质押物的现金应存入中国结算深圳分公司根据乙方申请为其开设的报价回购交易专用担保资金账户。

(二) 转入质押券保管库中的证券和转入担保资金账户中的现金, 作为乙方报价回购交易履约担保的质押物。全部质押物设定的质权由乙方所有报价回购未到期以及购回交易未完成资金划付的客户共同享有, 甲方所享有的质权不对应具体质押物品种, 甲方不得单独就质押物主张行使质权, 质押物处置所得由所有客户按债权比例公平受偿。处置后质押物有剩余的归乙方所有。

(三) 初始交易未完成资金划付及购回交易完成资金划付的客户不享有质权。

(四) 当质押物经折算后的标准券数量所对应金额超过乙方所担保的全部报价回购交易金额的, 乙方可以向中国结算深圳分公司申请将超出部分的质押物转出质押库, 或者申请将超出部分的担保资金转出担保资金账户。质押物或担保资金转出后, 不再作为乙方报价回购

交易履约担保的质押物。

(五)甲乙双方同意按下述条款进行质押物的选择与折算率的计算,质押物对应的担保价值按照设定的折算率进行计算和调整,甲乙双方愿意承担由此带来的损失或风险。

1、以符合深交所债券质押式回购交易相关规定的债券作为质押物的,标准券折算率适用《标准券折算率管理办法》。

2、以基金份额及深交所和中国结算认可的其他证券作为质押物的,由乙方聘请的、经深交所和中国结算认可的第三方机构确定和调整质押物的标准券折算率。

3、以现金作为质押物的,标准券折算率为 1。

(五)乙方已被司法冻结或其他原因冻结的质押物不计入标准券。

(六)甲方可向乙方或中国结算深圳分公司查询报价回购交易的相关情况,可查询的信息包括乙方质押物所折算的标准券总量、甲方未到期报价回购交易总量、乙方未到期报价回购交易总量。乙方和中国结算深圳分公司的数据如有不一致,以中国结算深圳分公司提供的数据为准。

(七)乙方保证其质押物和担保资金可以足额担保其履行所有未到期报价回购交易的义务。因质押物价值波动、折算率调整、司法冻结或扣划等原因导致质押物不足时,乙方最晚应于次两个交易日内补足。在质押物补足前,乙方有权拒绝甲方提出的初始交易委托。甲方已知悉并充分理解,报价回购交易的质押物可能会因质押物价值波

动、标准券折算率的调整、司法冻结、扣划等原因而导致质押物不足以担保乙方履行所有未到期报价回购交易的义务。

(八)甲乙双方参与报价回购交易,即表示其认可并愿意遵守《业务办法》关于质押物管理及质权设定的相关规定。

第七章 报价回购交易规则

第十三条 交易规则

(一) 报价回购价格、可用额度。乙方在每个交易日开市前通过自身网站或系统或营业场所公布当日开展报价回购交易各交易品种的到期购回报价、提前购回报价或价格确定方式,以及报价回购可用额度。乙方在日内可灵活调整各交易品种的可用额度,以应对客户需求的变化。乙方可能会根据实际情况限制单个客户买入单个交易品种及买入合计规模的上限。在任一交易日内,乙方有权根据各交易品种的实时可用额度,拒绝可能导致规模超限的委托或其他指令。甲方认可:其发出的委托可能因交易品种规模限制而被乙方拒绝,甲方对此不持任何异议,乙方对此不承担任何责任。甲方初始委托申报成功后,即视为甲方同意并接受当日公布的该品种报价。甲方已知悉并完全理解,该收益属于双方一致同意的约定收益,与其他市场收益可能存在偏差。

(二) 交易品种:各交易品种的期限均为一年以内。乙方可根据客户需求向深交所申请增加或减少期限品种,新设或减少品种将通过乙方公司官方网站或系统或营业场所公告。

（三）交易时间：同《业务办法》所规定的时间。甲方所有委托（包括但不限于初始委托、提前购回、自动续做、终止续做等）应当在交易时间内发出，所有交易和功能在下单后均不能撤销。

（四）委托数量：单位为张，1张为人民币100元；初始交易最低申报数量为10张，超出部分应当为10张的整数倍；提前购回交易最低申报数量为1张，超出部分应当为1张的整数倍。

（五）报价回购交易按日历时间（自然日）计算收益。到期购回日为非交易日的，到期购回日后第一个交易日为到期购回日。

（六）初始委托：甲方进行初始委托前，需开通报价回购交易业务权限。乙方对甲方初始委托进行前端监控，保证甲方资金账户中有足额的资金。乙方按照甲方有效初始委托的时间先后顺序向深交所申报初始交易，并即时冻结甲方资金账户内的相应资金。甲方已下单的初始委托不得撤销，甲乙双方必须承认交易结果，履行清算交收义务。于到期购回日甲方无需提交到期购回委托。报价回购交易业务暂停或终止的，适用于暂停或终止的情况。购回交易期限按自然日计算，若到期购回日为非交易日的，到期购回日顺延至下一个交易日。甲方自提交初始委托的下一交易日起享有利息收益，自到期购回日（或提前购回日）下一交易日起，不享有利息收益。

（七）提前购回：甲方可以在到期购回日前全部提前购回。甲方于提前购回日进行提前购回的，应当向乙方发出提前购回委托。提前购回的价格为该笔交易初始委托申报成功当日乙方公布的提前购回报价，甲方可进行部分提前购回。对于部分提前购回，乙方应当将初

始交易与甲方对应的提前购回交易进行合并管理，维护初始交易成交数量、保持初始交易属性（包括但不限于是否自动续做、初始委托金额、交易品种等）。提前购回交易申报成功后不得撤销，甲乙双方必须承认交易结果，履行清算交收义务。若 T 日提前购回金额（不包含当日买入后当日即提前购回的委托）占 T 日未到期报价回购交易的比例超过巨额比例限制的，则乙方有权拒绝任何导致上述比例超过巨额比例限制的委托。若 T 日单个交易品种提前购回金额（不包含当日买入后当日即提前购回的委托）占 T 日该交易品种未到期报价回购交易的比例超过巨额比例限制的，则乙方有权拒绝任何导致上述比例超过巨额比例限制的委托。若甲方提前购回金额（不包含当日买入后当日即提前购回的委托）超过乙方设定的单客户巨额提前购回限额，乙方有权拒绝任何导致上述情况发生的委托。乙方有权根据实际业务情况设置或更改巨额提前购回比例限制、巨额提前购回限额/单客户巨额提前购回限额等，但需及时进行公告或展示，公告或展示平台为乙方官方网站或营业场所或系统。

（八）自动续做与终止续做：自动续做是对报价回购交易到期后下一期交易达成方式的约定，若甲方选择自动续做的，则甲方在约定日期前不发出终止续做委托的，则视为同意按照相同的交易品种、张数、乙方于每一到期日公布的报价，自动达成下一期交易，直至甲方提出终止续做指令为止。自动续做可于任一交易日的交易时间申报。乙方始终对采用自动续期方式的报价回购交易的资金进行冻结，并由乙方于每个交易日批量处理当日有效的自动续做的报价回购交易。暂

时仅支持单笔回购交易的全部委托金额自动续做。自动续做需通过终止续做委托达到撤销的目的。自动续做期间，由于可用额度已用完或其他原因，甲方的自动续做可能在当日不成功，若甲方需要续做的，需于当日手动下达初始委托，并为该笔交易设置自动续做。报价回购交易业务暂停或终止的，适用于暂停或终止的情况。对于已设置自动续做的回购交易，甲方可对自动续做进行终止，称为终止续做或不再续做。暂时仅支持单笔回购交易的全部委托金额终止续做。若需要恢复自动续做的，则需要重新为回购交易提交自动续做委托。自动续做及终止续做仅对部分交易品种开放，具体以乙方公告或展示为准，公告或展示平台为乙方官方网站或营业场所或系统。

（九）其他约定：甲方应自行了解到期购回日日期，乙方没有提醒甲方到期购回日日期的义务；因甲方原因或乙方原因导致初始交易、到期购回或提前购回的交易或资金划付无法按本协议的约定完成的，违约方承担违约责任；甲方应当知悉，当任一品种的额度接近上限时，甲方的初始委托申请会因额度不足而被拒绝，之后如有新的额度释放，甲方或其他客户的初始委托申请会被接受；经深交所同意，乙方可以增加固定期限的交易品种。新增固定期限交易品种由乙方进行公告，适用本协议，法律法规或相关规则、方案另有规定的除外。

第十四条 清算交收

（一）报价回购按照“一次成交、两次结算”的原则处理。初始委托成交日，乙方根据成交金额进行初次清算；到期购回日，乙方按

照成交记录自动进行到期购回清算（提前购回情形除外）。报价回购交易实行 T+1 双边净额清算、非担保资金交收，由证券登记结算公司办理。

（二）T 日日终（T 日为初始交易、提前购回交易的申报日，或到期购回日），中国结算深圳分公司分别以乙方的自营结算备付金账户和客户结算备付金账户为单位，对当日全部报价回购交易金额（包括初始交易、提前购回交易和到期购回）进行轧差清算，清算金额保留小数点后 2 位：

1、对于初始交易，初始交易金额=初始交易成交数量（张）×100。

2、对于提前购回交易，提前购回交易金额=提前购回数量（张）×100×（1+提前购回报价×实际购回天数/365）。

其中：

实际购回天数=提前购回成交日对应交收日 - 初始交易成交日对应交收日。

提前购回报价为 1 元资金提前购回年收益，即提前购回年化收益率，最小变动单位为 0.001%。

3、到期购回

到期购回金额=到期购回剩余数量（张）×100×（1+到期购回报价×实际购回天数/365）。

其中：

未发生提前购回的，到期购回剩余数量是该笔回购初始交易成交数量；发生部分提前购回的，到期购回剩余数量是未购回的剩余未购

回数量。

到期购回报价为 1 元资金到期购回年收益，即到期购回年化收益率，最小变动单位为 0.001%。

实际购回天数=到期购回日对应交收日 - 初始交易成交日对应交收日。若资金按时正常交收，则到期购回日对应交收日为到期购回日下一个交易日，初始交易成交日对应交收日为初始交易成交日下一个交易日；若资金未按时正常交收的，则以中国结算深圳分公司的实际资金交收日期为准。

到期购回日为非交易日的，按照到期购回日后第一个交易日确定其到期购回日。

4、自动续做成交金额=初始交易成交数量（张）×100。

5、若到期购回，甲方本金和收益到期购回日当日可用，次一交易日可取款。

6、若提前购回，甲方本金提前购回日当日可用，本金和收益次一交易日可取款。

（三）T+1 日中国结算深圳分公司根据报价回购交易清算结果，分别在 12:00 和 16:00 在乙方自营结算备付金账户和客户结算备付金账户之间，对 T 日达成的所有报价回购交易办理资金交收。在 T+1 日 16:00，乙方自营结算备付金账户或客户结算备付金账户余额仍不足的，中国结算深圳分公司对乙方 T 日所有报价回购均不做资金交收处理。所有乙方 T 日发生的报价回购交易业务均延迟至 T+2 日办理交收。T+2 日，中国结算深圳分公司对乙方与乙方所有客户之间两个交

易日（T 日与 T+1 日）发生的报价回购交收顺序为先办理延迟交收再办理正常交收。若延迟交收失败，正常交收按失败处理。T+2 日对 T 日所有报价回购交易延迟交收失败的，违约方按本协议的约定承担违约责任。

（四）乙方与甲方之间的资金明细清算交收由乙方自行完成。乙方与甲方之间由于资金明细清算交收产生的法律纠纷与中国结算无关。甲方对成交或清算交收有异议的，须在成交或清算交收后三个交易日内以书面形式向乙方质询，双方协商解决，否则视为甲方认可成交或清算交收结果，甲方承担由此引起的任何法律后果和责任。

（五）因甲方或乙方原因导致初始交易、到期购回、提前购回或其他交易或资金划付无法按本协议及《业务办法》的约定完成的，则违约方承担违约责任。

（六）因乙方原因使得资金划付失败而造成甲方无法按约收到应收资金的，每延迟一天乙方按延迟交付金额的万分之三向甲方另行支付违约金。除此之外，乙方无需向甲方另行支付其他形式的补偿、赔偿或违约金等。

第八章 报价回购业务暂停和终止

第十五条 乙方被暂停报价回购交易权限时，甲方不能发起初始委托，但可提前购回。深交所恢复乙方报价回购交易权限后，甲方可发起初始委托。在乙方被暂停报价回购交易权限之前，所有报价回购交易正常申报。

第十六条 若因乙方过错，使得乙方报价回购交易业务被中国证监会或深交所要求停止而进入业务终止程序的，按如下方式计算甲方的应获得的资金收益：

（一）如果乙方在原约定到期购回日下一个交易日（含）前完成给甲方的资金支付，则按初始交易成交时按约定的到期购回报价及到期购回日计算收益。

（二）如果乙方在原约定到期购回日下一个交易日后完成给甲方的资金支付，则除按交易成交时约定的到期购回报价及到期购回日计算收益外，乙方还应就延期天数按照每日万分之三向甲方支付违约金，延期天数=实际资金划付日 - 原约定到期购回日下一个交易日。除此之外，乙方无需向甲方另行支付其他形式的补偿、赔偿或违约金等。

第十七条 因甲方原因导致乙方报价回购权限被暂停、终止或导致乙方对第三方造成违约责任的，则甲方承担相应赔偿责任，若给乙方造成的损失无法量化的，则由双方友好协商解决，协商解决不成的，按照本协议约定申请仲裁。

第九章 异常情况处理

第十八条 甲方授权乙方以乙方的名义与第三方主体签署质押券处置委托协议。质押券处置委托协议应载明处置的条件、程序、时限，双方的权利与义务，合同的生效与终止等内容。

第十九条 乙方发生以下情形之一的，深交所可以终止其报价回

购交易权限：

（一）严重违反相关法律法规、中国证监会部门规章、本办法及深交所和中国结算其他交易、登记结算业务规则。

（二）乙方进入风险处置或破产程序。

（三）乙方连续两个交易日无法完成资金划付。

（四）因质押物价值波动、折算率调整、司法冻结或扣划等原因导致质押物不足，且乙方未能在规定的时间内采取有效措施使其报价回购可用额度不小于零。

（五）乙方向深交所提出申请，终止其报价回购交易权限。

（六）证监会或深交所认定的其他情形。

第二十条 乙方报价回购交易权限终止后，甲乙双方同意按照如下程序处理：

（一）权限终止当日，甲乙双方的所有未到期报价回购交易全部提前到期，回购价格为提前购回报价；

（二）乙方应及时向深交所及中国结算深圳分公司提交质押券处置申请；

（三）对符合要求的申请，由乙方按照价格公允、快速处置的原则对质押券进行处置；质押券为基金专户份额的，乙方应及时通知基金专户管理人，待基金专户管理人将基金资产全部变现后，乙方申请将基金专户份额全部赎回，所得资金转入担保资金账户；处置所得与担保资金之和按债权比例优先向所有客户公平清偿；

（四）仅当乙方怠于、不当或无法处置的，由委托的第三方按照价格公允、快速处置的原则对质押券进行处置，处置所得与担保资金之和按债权比例优先向客户公平清偿；

（五）甲方获得足额偿付的，应与乙方签署债务了结的确认函；

（六）全部债务清偿后，乙方应向深交所和中国结算深圳分公司提交业务终止报告，并可申请解除剩余质押物的质押登记；

（七）处置所得与担保资金之和仍不足以偿付的，由乙方对客户承担全部法律责任。

第二十一条 报价回购待购回期间发生的异常情况处理方式：

（一）乙方质押券或担保资金被司法等有权机关冻结或强制执行的；

（二）乙方被暂停或终止报价回购交易权限的；

（三）乙方进入风险处置或破产程序的；

（四）甲方资金账户被司法等有权机关冻结或强制执行的；

（五）质押券到期的。

发生第（一）项情形的，乙方应当及时通知甲方，同时应在冻结或强制执行当日向质押库或担保资金账户内补足相应数量的质押券或担保资金。

发生第（二）项情形的，乙方应当及时通知甲方，应在权限暂停或终止之日开市前，通过其营业场所或官方网站或系统进行公告，并按照本协议及《业务办法》约定的业务暂停或终止程序进行处置。

发生第（三）项情形的，乙方应当及时通知甲方，不再接受甲方新的初始委托。

发生第（四）项情形的，甲方应及时通知乙方，乙方注销甲方报价回购交易权限，不再接受甲方新的委托，乙方对甲方所有的未到期回购交易强制进行提前购回。若因此无法完成初始交易交收并导致乙方遭受损失的（包括但不限于由此导致乙方对第三方造成的违约赔偿责任等），由甲方承担。

发生第（五）项情形的，乙方应及时向质押库或担保资金账户内补足相应数量的质押券或担保资金。

任何一方因违反本协议约定导致异常情况发生的，应当向受影响的对方承担违约责任。

第十章 违约处理与法律责任

第二十二条 甲乙双方须严格、全面履行本协议相关条款，任何一方不得违约，否则，除法律规定或本协议约定可以免责的以外，违约方应承担违约责任。

因报价回购业务产生的任何争议、纠纷，由甲乙双方协商或通过约定的争议处理方式解决，与任何第三方无关，甲方无权向任何第三方主张权利或追究责任。

乙方与甲方之间的纠纷，不影响中国结算深圳分公司依据深交所确认结果已经办理或正在办理的证券质押登记、资金划付等业务。

第二十三条 甲方违反本协议相关条款约定，导致本协议全部或部分不能履行的，应当承担相应的法律责任。

第二十四条 甲方违反本协议相关条款约定的，乙方有权采取警告、责令改正或暂停甲方参与报价回购业务权限、终止协议等措施。如造成乙方实际损失的，乙方有权向甲方要求赔偿。赔偿的范围包括但不限于相应款项、收益、利息、交易费用、罚息、违约金、赔偿金额和追索费用等。

第二十五条 甲方行为构成报价回购交易业务资金交收失败，乙方可直接对甲方的资金或证券进行处分，包括但不限于限制取款和限制交易、留置、扣划资金等，并自违约之日起按相关约定向甲方收取违约金，由此造成的全部损失和法律后果由甲方自行承担。

第二十六条 乙方未按照甲方的委托及本协议约定进行报价回购交易，给甲方造成损失的，甲方有权按照本协议约定要求乙方予以赔偿，但本协议另有约定的除外。

第二十七条 因乙方原因造成甲方无法按时收到资金的，每延迟一天乙方按延迟交收的应付金额的万分之三向甲方支付违约金，除此以外乙方无需向甲方另行支付其他任何形式的补偿、赔偿或违约金等。非乙方原因造成甲方无法按时收到资金的，乙方不承担责任。

第二十八条 甲乙双方均有保守秘密的义务，未经另一方事先书面许可，任何一方不得对外披露、透露或提供与本协议有关的信息或内容。违反本约定给对方造成损失的应当负赔偿责任。国家有查询权

限的部门依照法律规定要求查询或要求提供与本协议有关内容的，不受前款约束。

第十一章 免责条款

第二十九条 因出现火灾、地震、瘟疫、社会动乱等不能预见、避免或克服等不可抗力情形，或因出现无法控制和不可预测的系统故障、设备故障、通讯故障、电力故障等异常事故，或因本协议生效后新颁布、实施或修改的法律、法规、规章、规则或政策等因素，导致协议任何一方不能及时或完全履行本协议的，其相应责任应予免除。

第三十条 遭受不可抗力、异常事故或知悉政策法律变化的一方应在遭受不可抗力、异常事故或知悉政策法律变化后尽快通知另一方，双方应积极协调善后事宜。

第十二章 法律适用和争议的解决

第三十一条 有关本协议的签署、效力和争议解决等均适用中华人民共和国法律、法规及其他有关规章、规则。本协议签署后，如果相关法律、法规、规章或规则修订的，应按新修订的法律、法规、规章、规则办理，但本协议其他内容及条款继续有效。

第三十二条 本协议根据法律、法规、规章、规则的规定，如需修改或增补，修改或增补的内容由乙方在其营业场所内以公告形式通知甲方，若甲方在七日内不提出异议，则公告内容即成为本协议组成部分。如甲方在约定时间内提出书面异议，甲乙双方一致同意提前终

止甲方未到期的报价回购业务，自甲乙双方完成回购交易之日起，本协议自动终止。

第三十三条 本协议执行中如出现争议，应首先通过友好协商解决。协商解决不成的，甲乙双方同意提交上海仲裁委员会仲裁，适用该委员会当时有效的仲裁规则。该仲裁裁决结果是终局的，甲乙双方特此同意不可撤销地服从该仲裁委员会的裁决结果。甲乙双方排除诉讼作为争议解决的方式。

第三十四条 因报价回购业务产生的任何争议、纠纷，由甲乙双方协商或通过约定的争议处理方式解决，与任何第三方无关，甲乙双方无权向任何第三方主张权利或追究责任。

甲乙双方之间的纠纷，不影响证券登记结算公司依据交易所所确认结果已经办理或正在办理的证券质押登记、资金划付等业务。

第三十五条 甲方联系方式如有变更，应于变更之日起两个交易日内书面通知乙方。在报价回购交易业务中，如需乙方对甲方通知相关事宜，因通讯故障或甲方更改联系方式但未及时告知乙方而导致甲方未收到前述通知的，乙方不承担责任。

第十三章 附则

第三十六条 报价回购交易按照深圳证券交易所和中国结算公司的有关规定执行。

第三十七条 本协议有效期为一年，如双方在协议到期日之前未

提出异议的，则本协议有效期限自到期日起自动延期一年，可多次延期，每次一年。

第三十八条 乙方于本协议生效前所作的宣传、广告、说明、承诺、证明、意向或其它交易条件，无论是否已经协议各方口头或书面确认，均以本协议相关条款为准。

第三十九条 除以上协议变更事项外，本协议中乙方需要通知甲方的其他事宜，乙方可采取电话、手机短信、传真、邮件、系统提示或其他形式通知，通知发出即视为乙方已履行了通知义务。甲方应在乙方处留存有效的联系方式，该联系方式发生变更的，应及时通知乙方，否则乙方不承担通知不能送达甲方的责任。

第四十条 本协议未尽事宜，可由甲乙双方协商解决并另行签署补充协议。协商不一致或未签署补充协议之前，仍按本协议相关条款执行。

第四十一条 甲方为个人投资者的，本协议自甲方本人签字，乙方加盖公章之日起生效；甲方为机构投资者的，本协议自甲方法定代表人或授权代表签字，甲乙双方加盖公章之日起生效。本协议可以采用电子签名、数据电文等电子方式签署。

本协议自甲方撤销证券账户，或甲乙双方协议解除本协议之日起失效。

第四十二条 本协议一式两份，甲、乙双方各执一份，每份具备

同等法律效力。

（本页无正文，为《海通证券股份有限公司深交所质押式报价回购交易客户协议》签署页。）

甲方确认，乙方已经向甲方讲解报价回购业务规则和本合同内容，提示并详细说明报价回购业务的风险，知悉乙方不保证甲方获得投资收益或承担甲方投资损失。

甲方确认，已经认真阅读并全面接受本协议全部条款，已充分知悉、理解本协议项下的权利、义务和责任，自愿参与报价回购交易并自行承担由此产生的风险和法律后果。

资金账户： _____

证券账户： _____

投资者（代理人）签章： _____

签署日期： _____