

中信建投证券股份有限公司
质押式报价回购交易客户协议

中信建投证券股份有限公司
质押式报价回购交易客户协议

甲 方： _____
证件名称： 身份证 或 营业执照 或 _____
证件号码： _____
法定代表人（机构客户适用）： _____
通讯地址： _____
邮 编： _____ E-mail： _____
固定电话： _____ 联系人手机： _____
客户号： _____ 资金账号： _____
上海证券账号： _____ 深圳证券账号： _____

乙 方： 中信建投证券股份有限公司
法定代表人： 王常青
地址： 北京市东城区朝内大街 188 号
联系电话： 4008888108

依据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国合同法》、《深圳证券交易所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、规章、规范性文件，以及深圳证券交易所（以下简称“深交所”）和中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）的相关业务规则及规定（以下简称“有关规定”），在平等自愿、诚实信用的基础上，就甲、乙双方开展深交所质押式报价回购（以下简称“深交所报价回购”）交易及相关事宜，达成本协议，供双方共同遵守。

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：乙方通过基金管理公司设立特定客户资产管理计划（以下简称“基金专户”），以其持有的该基金专户份额、现金以及其他深交所和

中国结算认可的乙方自有证券作为交易所市场质押式回购的质押品，并根据标准券折算率计算出的标准券总额为融资额度，向甲方以乙方报价甲方接受报价的方式融入资金，甲方于回购到期时收回融出资金并获得相应收益的质押式报价回购交易。

- (二) 标准券折算率：一单位基金专户份额所能折成的标准券代表的金额与一单位基金专户份额的净值之比。
- (三) 基金专户份额：乙方作为特定客户资产管理计划委托人所持有的基金专户的份额。
- (四) 质押专用账户：乙方为开展报价回购业务在中国结算深圳分公司设立的“中信建投证券股份有限公司质押式报价回购交易质押券保管库”（以下简称“质押券保管库”）及存入充当报价回购交易质押物的现金的报价回购交易专用担保资金账户。质押券保管库及专用担保资金账户，合称为“质押专用账户”。
- (五) 初始交易：甲乙双方之间进行的，由乙方提供基金专户份额、现金作为质押物向甲方融入资金的交易。
- (六) 购回交易：甲方收回融出资金并获得相应收益的交易，包括到期购回和提前购回。
- (七) 质押物/质押券/质押份额：乙方质押专用账户中已设立质押法律关系的基金专户份额、自有证券和现金。
- (八) 报价回购的委托价格：每百元资金到期年收益。
- (九) 提前购回价格：每百元资金提前购回年收益。
- (十) 提前购回：甲方根据本协议的约定在回购到期日前向乙方发出提前购回委托，乙方接收委托并向深交所交易系统提交申报，经深交所交易系统确认后，该日即为提前购回日。甲方提前购回的收益按该笔回购的提前购回年收益率计算确定。
- (十一) 自动续做：回购到期日，如果甲方未发出不再续做指令，即视为甲方自愿按原购回金额（不含回购收益）自动滚动续做相同的交易品种，甲方不需要下达回购初始交易委托。
- (十二) 不再续做交易（在乙方系统上亦称终止续做）：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。
- (十三) 交易日：指在深交所能进行报价回购委托及交易的日期，该交易日由深圳证券交易所确定。
- (十四) 资金账户：指客户在其指定交易的证券公司开立的“主资金账户”（资金交易账户），用于证券交易、清算交收和资金划转。
- (十五) 中国证监会：中国证券监督管理委员会。
- (十六) 深交所：深圳证券交易所。
- (十七) 中国结算深圳分公司：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。
- (十八) 初始交易的申报价格：甲乙双方之间进行的，由乙方提供基金专户份额、现金作为质押物向甲方融入资金的每百元资金到期年收益。

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，

并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，以及乙方制定的相关业务规定。

- (二) 甲方保证用于报价回购业务的资产（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。
- (三) 甲方已仔细阅读本协议、《质押式报价回购交易风险揭示书》（以下简称“《风险揭示书》”）、《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、本协议、《风险揭示书》、《产品资料概览》内容的充分说明，准确理解本协议及《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业务涉及的相关风险，愿意接受本协议的约束。
- (四) 甲方承诺以真实身份参与报价回购交易，保证签署本协议时及本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，保证在信息和资料发生变化时及时到乙方办理变更手续。
- (五) 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。
- (六) 甲方保证在本协议期内维持前述声明和保证始终真实有效。

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，并经深交所批准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，以及乙方制定的相关业务规定。
- (三) 乙方用于报价回购的资产（包括资金和证券）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) 乙方自营账户内的基金专户份额、自有证券在作为报价回购质押物提交时未设定其他质押权利或存在其他可能影响报价回购交易的权利瑕疵。
- (六) 乙方保证在本协议期间内维持前述声明和保证始终真实有效。

第三章 一般规定

第四条 甲方与乙方进行报价回购，甲方委托并授权乙方按相关业务规则办理报价回购的交易、登记结算以及其他与报价回购有关的事项，甲乙双方均充分知晓、认可并同意遵守报价回购业务的交易、登记结算等事宜的相关安排。乙方接受甲方的委托和授权。

第五条 甲方参与报价回购业务，须通过乙方的资质审查。资质审查条件包括但不限于以下内容：开户时间、资产规模、信用状况、风险承受能力及对证券市场的认知程度等。

第六条 甲方通过乙方资质审查前，乙方将拒绝甲方参与报价回购业务的申请，甲方的有关委托指令视为无效。

第七条 甲乙双方均确认并同意：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。

第八条 甲乙双方均确认：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。

第九条 甲方进行初始交易委托时应保证其资金账户中有足够的资金，保证根据成交结果承担相应的清算交收责任，否则乙方有权拒绝甲方的委托指令。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。

第十条 甲方已充分理解并同意，在报价回购业务中，乙方是甲方回购交易的对手方，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 甲乙双方的权利和义务

第十一条 甲方的权利和义务

(一) 甲方的权利：

- 1、甲方经乙方资质审查合格取得报价回购交易资格后，可按本协议约定申请报价回购交易。
- 2、甲方存在未到期报价回购时，可按本协议约定向乙方或中国结算深圳分公司查询其名下报价回购及对应的质押登记情况，未完成资金划付的初始回购交易除外。
- 3、按本协议约定申请提前购回。
- 4、按本协议约定申请不再续做。
- 5、获取报价回购收益。
- 6、相关法律、法规、规范性文件、业务规则及本协议约定的其他权利。

(二) 甲方的义务：

- 1、甲方进行新开报价回购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。因甲方资金账户中资金余额不足或账户状态不正常导致交易失败的，由甲方承担一切责任。
- 2、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。
- 3、如实按乙方的要求提供各类身份证明材料和信用状况证明文件，并对所提供的各类文件、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。
- 4、按时、足额向乙方支付应付报价回购交易对价和交易费用。
- 5、甲方对成交和清算交收有异议的，须在本协议约定时限内向乙方质询，否则视为甲方确认成交和清算交收结果。
- 6、甲方承诺妥善保管自身账户和密码等相关资料，任何通过甲方账户和密码进行的操作（包括但不限于初始交易委托、不再续做委托、提前购回委托、撤单委托或其他指令）均视为甲方行为，系基于甲方真实意愿做出；由于密码失密给甲方造成损失的，甲方自行承担全部经济损失和法律后果。
- 7、甲方发生重大诉讼、仲裁、进入破产程序或者其他可能导致本协议和具体交易无法正常履行的事件，应及时通知乙方。
- 8、相关法律、法规、规范性文件、业务规则及本协议约定的其他义务。

第十二条 乙方的权利和义务

(一) 乙方的权利:

- 1、要求甲方提交与报价回购交易相关的各类身份证明材料、信用状况证明文件及其他相关文件,对相关内容进行解释或说明;可以合法方式对甲方的资信状况、履约能力进行必要的调查。
- 2、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甲方除提前购回外的其他委托。
- 3、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券保管库,或者申请将超出部分的担保资金转出专用担保资金账户。
- 4、发生大额提前购回或大额不再续做时,甲方应按约定进行提前预约,否则,乙方有权拒绝甲方的提前购回或不再续做委托申请。
- 5、按本协议约定向甲方收取报价回购交易的交易对价和交易费用。
- 6、交易时间内发现甲方资金不足时,因非正常原因造成甲方初始交易指令被申报的,乙方在深交所确认成交之前有权向深交所申请将相应的申报作废。
- 7、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。
- 8、相关法律、法规、规范性文件、业务规则及本协议约定的其他义务。

(二) 乙方的义务:

- 1、除本协议另有约定外,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、确保报价回购业务规模不超过乙方所提交的质押物折算后的总额度及其他报价回购额度控制的相关规定。
- 5、在本协议内容或有关业务规则变更后,及时通知甲方。
- 6、发生重大诉讼或仲裁、报价回购交易资格被暂停或终止、进入破产程序或者其他可能导致本协议和具体交易无法正常履行的事件,应及时通知甲方。
- 7、未经甲方同意,不得以任何方式转让本协议项下的各项权利与义务,法规或监管机构另有规定的除外。
- 8、相关法律、法规、规范性文件、业务规则及本协议约定的其他义务。

第五章 回购品种、交易及查询

第十三条 报价回购品种分为:

- (一) 含提前终止权的品种: 14天、1月、2月、3月、6月、9月、12月;
- (二) 不含提前终止权的品种: 1天、7天、14天、1月、2月、3月、6月、9月、12月;
- (三) 定制品种: 客户可根据自身需求提出非标准期限回购申请,经乙方评议通过后单独开展。

第十四条 交易时间

- (一) 新开回购：每个交易日的9：15至11：30，13：00至15：30；
- (二) 提前终止：每个交易日的9：15至11：30，13：00至14：00；
- (三) 终止续做：每个交易日的9：15至11：30。

乙方有权拒绝甲方在非上述交易时间的委托。

第十五条 交易方式

每天定量、定价挂牌，深交所确认成交。

第十六条 委托方式

甲方可通过乙方网上交易系统、营业部柜台和场内热自助等方式进行委托。

第十七条 委托数量

甲方单笔最低申报数量为10张（总面值人民币1000元），超出部分需按10张的整倍数增加。

第十八条 申报价格

指由乙方确定的各回购品种的每百元资金到期年收益和提前购回年收益，每个交易日9:30前，在乙方公司网站予以公布。申报价格包括：

- (一) 委托价格：每百元资金到期年收益；
- (二) 提前购回价格：每百元资金提前购回年收益。

第十九条 报价方式

乙方在每交易日开市前通过公司网站及交易系统公布各报价回购品种的到期年收益率和提前购回年收益率。甲方初始交易委托一经确认，即视为甲方同意并接受该等年收益率。甲方已知悉并完全理解，该等收益率属于双方一致同意的约定收益率，与其他市场利率可能存在偏差，甲方自愿接受并承担由此造成的风险。

第二十条 申报与成交回报要素

(一) 初始交易的申报要素包括：合同编号、申报日期和时间、甲方证券账号及其指定交易单元号，乙方专用证券账号及其指定交易单元号、交易代码、初始交易申报价格、提前购回价格、申报数量、交易类型等内容。

初始交易的成交回报要素包括：成交编号、合同编号、成交日期和时间、甲方证券账号及其指定交易单元号、乙方专用证券账号及其指定交易单元号、交易代码、初始交易成交价格、成交数量、交易类型等内容。

(二) 提前购回的申报要素包括：合同编号、申报日期和时间、甲方证券账号及其指定交易单元号、乙方专用证券账号及其指定交易单元号、交易代码、初始交易申报价格、提前购回价格、申报数量、交易类型、要提前购回的订单的申报日期、要提前购回的订单的成交编号、提前购回的价格等内容。

提前购回的成交回报要素包括：成交编号，合同编号，成交日期和时间，甲方证券账号及其指定交易单元号，乙方专用证券账号及其指定交易单元号，交易代码，提前购回价格，成交数量等内容。

第二十一条 资金使用

甲方当日卖出证券所得资金，在T+0日即可参与乙方报价回购业务；甲方当日到期购回或提前购回交易所得资金T+0日可用，甲方当日可继续参与报价回购业务或买入其他证券产品，但资金T+1日方可取出。

第二十二条 回购总量控制

乙方在开展报价回购业务前，须先行向质押专用账户提交质押份额，根据所提交的质押份额数量获得一定的报价回购额度，乙方需保证其报价回购业务的总

量不得超过该额度。

第二十三条 回购品种规模控制

乙方有权根据市场变化及质押份额规模，在每个交易日自行确定各个报价回购品种的规模上限，并通过公司网站及交易系统公布。在任一交易日内，乙方有权根据各报价回购品种的实时可用余额数据，拒绝可能导致规模超限的委托。

第二十四条 提前预约控制

(一) 任一交易日内，若甲方累计不再续做委托或累计提前购回委托的委托金额达到或超过人民币3000万元以上，须在前一交易日15:00前向乙方进行预约，否则乙方当日有权拒绝甲方不再续做和提前购回的申请。

(二) 若乙方客户当日提前预约的不再续做和提前购回委托总金额，达到乙方大额购回限额时（定义见下文），则乙方有权对超过大额购回限额之后的预约申请，认定为无效预约。

第二十五条 大额购回控制

甲乙双方确认，在任一交易日内，乙方客户回购的当日累计不再续做委托和当日累计提前购回委托总金额，超过乙方上一交易日全部品种未到期余额的30%时，认定乙方发生大额购回，当日除甲方已成功办理提前预约之外，乙方有权拒绝甲方不再续做或提前购回的申请。

第二十六条 成交规则

甲、乙双方确认并同意以下成交规则：

(一) 成交规则：价格约定，时间优先。

1、价格约定是指乙方将在每日开盘前公布各产品申报价格，以及当日各期限回购品种的可回购规模，甲方进行委托即表示同意相关产品价格。

2、时间优先是指深交所按乙方客户下单先后时间顺序进行确认。

(二) 乙方不提供单笔委托部分成交功能，如甲方委托超过乙方回购规模额度，则整笔委托无效。

(三) 如乙方额度用完，系统将即时提示客户不能成交；在乙方当日额度用完后，如有已购买回购产品客户发出“提前购回”指令，系统会相应增加乙方当日额度，此时如有客户下单，系统会确认。因此，将可能出现先下单客户没有确认，后下单客户却成交的情况。

(四) 交易日收市后，报价回购申报经深交所交易系统确认成交，交易即告成立，公司和客户必须接受交易结果。

(五) 报价回购交易成交后，甲、乙双方均不得撤销该报价回购交易或变更其数量、价格或期限等。

第二十七条 报价回购产品按日历时间计算收益。若到期日为非交易日，顺延至下一交易日。

第二十八条 1天期限、到期自动续做回购品种（以下简称“132004回购”）

(一) 定义：指回购期限为1天，甲方未发出不再续做指令则视为自愿按回购金额自动续做的回购品种。其中，在自动续做期间的132004回购的每日年收益率由乙方根据市场行情变化决定，并通过乙方网站以及交易系统公布，甲方对该等收益率均予认可。

(二) 交易代码：132004

(三) 交易过程

1、 委托：甲方发出初始交易132004回购委托，一经成交确认，甲方未在约定交易时间发出不再续做指令的，则视为甲方自愿委托并授权乙方将

该笔回购按原委托金额自动续做，乙方应基于甲方的委托和授权，在自动续做期间每日代甲方进行委托申报。

甲方的委托指令主要包括合同编号、申报日期和时间、客户证券账号及其指定交易单元号，证券公司专用证券账号及其指定交易单元号、交易代码、初始交易申报价格、提前购回价格、申报数量、交易类型等内容。其中，自动续做期间的委托价格由乙方根据市场行情变化决定，并通过乙方网站以及交易系统公布，甲方对该等委托价格均予无条件认可，并授权乙方代为申报。

乙方有权对132004回购进行规模控制。在任一交易日内，若甲方的初始交易委托或自动续做委托将导致132004回购规模超限，乙方有权拒绝超过规模上限部分的整笔委托。

2、 申报：乙方按照有效委托的时间先后顺序及时向深交所申报，并即时冻结甲方资金账户内的相应资金。

3、 成交：申报经深交所交易系统确认成交后，交易即告成立，甲乙双方必须承认交易结果，履行清算交收义务。

4、 不再续做：甲、乙双方确认，甲方仅可在交易日的9:30-11:30期间申请132004回购不再续做，甲方发出不再续做委托经乙方交易系统确认后，则132004回购不再续做，回购本金及收益当日可用不可取。甲方当日累计不再续做委托金额达到或超过3000万以上，须提前一天预约。

5、 不再续做限制：在任一交易日内，若乙方发生大额购回情况，或甲方当日不再续做委托累计金额达到或超过人民币3000万元且没有在前一交易日15:00前与乙方进行预约，乙方当日有权拒绝接受甲方的不再续做申请，甲方回购金额自动续做。

(四) 收益计算

1、 甲方回购期间总收益=∑回购期间每日适用年收益率（节假日年收益率同节假日上一交易日乙方公布的年收益率）×回购金额×1/365；

2、 甲方每交易日的收益由乙方按日支付。

(五) 其他约定

1、 甲方回购到期日遇节假日顺延；

2、 回购交易成交后，甲方不得以任何理由撤销该回购交易或变更其数量、价格或期限等。

第二十九条 7天期、14天期、28天期、91天期回购品种

(一) 定义：7天期、14天期、28天期、91天期回购品种是指回购期限分别固定为7天、14天、28天或91天，收益率以成交当天乙方公布的到期年收益率为准（回购提前购回的情形除外），回购期满后进行本息结算和支付的回购品种。乙方公布的年收益率，不得低于当日中国人民银行公布的活期存款利率。

(二) 交易代码（待修改）：7天期、14天期、28天期、91天期回购品种的交易代码分别为132004007007、132004014014、132004028028、132004091091。

(三) 交易过程

1、 委托：甲方向乙方发出初始交易委托。甲方的委托指令主要包括合同编号、申报日期和时间、客户证券账号及其指定交易单元号，证券公司专用证券账号及其指定交易单元号、交易代码、初始交易申报价格、提前购回价格、申报数量、交易类型等内容。乙方有权对各回购品种进行规模控制。在任一交易日内，若甲方的初始交易委托将导致该回购品种规模超限，乙方

有权拒绝超过规模上限部分的整笔委托。

2、 申报：乙方按照甲方有效委托的时间先后顺序及时向深交所申报，并即时冻结甲方资金账户内的相应资金。

3、 成交：申报经深交所交易系统确认成交后，交易即告成立，甲、乙双方必须承认交易结果，履行清算交收义务。

4、 回购到期：在回购到期日，乙方根据本条第（四）项列明的回购到期总收益公式逐笔计算回购总金额，并进行资金结算，客户资金当日可用不可取。

5、 提前购回：甲方可在回购到期日前向乙方发出提前购回指令。提前购回的持有期收益按该笔回购成交日乙方公布的提前购回年收益率计算确定。甲方提前购回的申报要素包括合同编号、申报日期和时间、客户证券账号及其指定交易单元号、证券公司专用证券账号及其指定交易单元号、交易代码、初始交易申报价格、提前购回价格、申报数量、交易类型、要提前购回的订单的申报日期、要提前购回的订单的成交编号、提前购回的价格等内容。甲方当日累计提前购回委托金额达到或超过3000万以上，须提前一天预约。

6、 提前购回限制：在任一交易日内，若乙方发生大额购回情况，或甲方当日提前购回委托累计金额达到或超过人民币3000万元且没有在前一交易日15:00前向乙方进行预约，乙方当日有权拒绝接受甲方的提前购回委托申请。

（四）收益计算

1、 甲方回购到期总收益率=回购成交日乙方公布的到期年收益率×回购金额×实际持有天数/365；其中，实际持有天数为初始成交日对应的资金划付日起至到期终止日对应的资金划付日（不含该日）期间的日历天数。

2、 甲方提前购回总收益=回购成交日乙方公布的提前购回年收益率×回购金额×实际持有天数/365；其中，实际持有天数为成交日起至提前购回日（不含该日）期间的日历天数。

（五）其他约定

1、 回购交易成交后，甲方不得以任何理由撤销该回购交易或变更其数量、价格或期限（提前购回的情形除外）等；

2、 甲方回购到期日遇节假日顺延，甲方应自行了解回购到期日期，乙方没有提醒甲方回购到期日期的义务；

3、 甲方在回购到期日作出提前购回回购的委托，将视为无效委托，乙方不予申报确认；

4、 经深交所同意，乙方可以增加固定期限的回购品种。新增固定期限回购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。

第三十条 查询

（一）每日可买规模及行情报价

每个交易日开盘前，甲方可通过乙方公司网站报价回购业务专栏，查询当天每个品种可买规模及相关收益率。

（二）账户信息

甲方可以通过乙方公司网上交易终端、营业部柜台及热自助系统，查询甲方未到期报价回购及相对应的乙方质押份额明细、报价回购交易流水等账户信息。

（三）其它查询路径

甲方也可根据《业务办法》规定直接向中国结算深圳分公司申请查询其名下报价回购及对应的质押登记明细情况。

第六章 质押物管理

第三十一条 质押物的选择标准与担保价值计算

（一）甲乙双方确认

以基金专户份额作为本协议项下质押物的，按照由交易所认可的第三方机构对基金专户估值后的折算比率进行折算。折算比率在公司官网上进行公布，并由第三方机构定期调整。

（二）甲乙双方确认

以现金作为本协议项下质押物的，标准券折算率为1。

（三）甲乙双方确认

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》。

第三十二条 质押物的转入转出

（一）质押物的转入。乙方通过中国结算深圳分公司D-COM系统将其持有的基金专户份额作为质押物申报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（质押券保管库及专用担保资金账户，以下合称“质押专用账户”）。

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。

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。

（二）质押物转出条件。甲乙双方确认，当质押基金专户份额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。质押券或担保资金转出后，不再作为乙方报价回购交易履约担保的质押物

第三十三条 质押登记

中国结算深圳分公司受深交所委托根据成交结果及深交所确定的质押份额分配原则对未到期回购及到期资金划付失败的回购办理相应的质押登记。相关质押登记办理后，乙方与甲方质押关系建立。若当日司法机关依法对质押专用账户内相关基金专户份额提出冻结要求的，已被司法冻结的基金份额不计入标准券，但不影响报价回购客户对该质押基金份额享有的质权。全部质押物设定的质权由乙方所有报价回购未到期以及到期资金划付失败的客户共同享有，客户所享有的质权不对应具体质押物品种，客户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。对于已到期且已完成资金划付的回购，质押登记解除，乙方与甲方质押关系终止。

甲方委托乙方向深交所提交的报价回购交易申报即视为甲方向中国结算深

圳分公司提交的按照《业务办法》规定办理质押登记的申请。

第三十四条 质押登记明细的查询方式和查询内容

(一) 中国结算深圳分公司受深交所委托于每个交易日日终向乙方发送质押登记明细数据。

(二) 甲方可以向乙方或中国结算深圳分公司申请查询乙方质押物所折算的标准券总量、自己名下的每笔未到期回购总量、乙方未到期报价回购总量。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。

第三十五条 乙方保证质押专用账户内的质押份额可以足额担保乙方履行其购回所有未到期报价回购的义务。甲方已知悉并充分理解，乙方提交的、用于报价回购的质押份额可能会因标准券折算率的调整、司法冻结、扣划等原因而不足以足额担保乙方履行购回所有未到期报价回购的义务。如质押专用账户中的质押份额因折算率调整、司法冻结、扣划等原因导致报价回购质押份额不足，乙方最迟应于次一个交易日内补足质押份额。次一交易日内，乙方有权暂停接收甲方初始回购委托或自动续做委托，只接收提前购回和不再续做委托。

第七章 清算和交收

第三十六条 报价回购按照“一次成交、两次结算”的原则处理。报价回购成交日，乙方根据成交金额进行初次清算；报价回购到期日，乙方按照成交记录自动进行回购清算（提前购回的情形除外）。

第三十七条 甲方对成交和清算交收有异议的，须在成交后三个交易日内以书面形式向乙方质询，否则视为甲方确认成交和清算交收结果，甲方承担由此引起的任何法律后果和责任。

第三十八条 甲乙双方对报价回购交易的清算、资金划付约定如下：

(一) 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。

(二) T+1 日，中国结算深圳分公司根据报价回购交易清算结果在乙方自营结算备付金账户和客户结算备付金账户之间办理资金划付，最后一批次的资金划付时点为 16:00。乙方自营结算备付金账户或客户结算备付金账户应付资金不足的，中国结算深圳分公司对乙方当日全部报价回购均不做资金划付处理，当日所有资金划付的履行期限顺延至 T+2 日办理。

(三) 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。

第三十九条 乙方报价回购资金划付失败的，双方当日的报价回购交易及到期购回、提前购回全部延迟至下一交易日，具体处理如下：

(一) 对于甲方初始回购交易，乙方当日冻结甲方全部初始回购金额，并于下一交易日完成申报、交收，双方质押关系建立。冻结期间，乙方按照初始回购交易日约定的到期年收益率向甲方进行补偿。

(二) 对于甲方到期购回或提前购回交易(T日)，T日甲乙双方质押关系保持不变，T+1日日终完成申报、交收后自动解除质押登记，双方质押关系终止，

甲方资金T+2日可取。若甲方T日未使用购回资金可用额度的，延迟交收期间乙方每日按延迟交付金额的万分之三向甲方支付赔偿；若甲方T日已使用购回资金可用额度的，乙方对已使用部分资金不予赔偿，并有权对甲方账户进行限制（限制撤销指定和转托管），待T+1日完成申报、交收后解除限制。T+2日乙方仍未能完成资金划付的，乙方应承担违约责任。

（三）乙方连续两个交易日资金划付失败的，深交所可终止乙方报价回购业务权限，进入业务终止处理。

第八章 业务暂停和终止

第四十条 乙方发生以下情形之一的，深交所可暂停其报价回购业务权限：

（一）乙方违反相关法律法规、中国证监会部门规章、《业务办法》及深交所和中国结算其他交易、登记结算业务规则；

（二）乙方质押专用账户因质押物价值波动、质押份额折算率调整、司法冻结或扣划等原因导致质押物不足；

（三）乙方资金划付失败；

（四）深交所认定的其他情形。

第四十一条 乙方质押专用账户因质押份额折算率调整、司法冻结或扣划等原因导致质押物不足时，深交所将在次一交易日暂停接收乙方报价回购初始交易及质押物转出申报，只接收提前购回与质押物转入申报。待乙方报价回购可用额度大于等于零后，深交所方可恢复乙方报价回购权限。

乙方于质押物不足之日起次两个交易日内未能采取有效措施使其报价回购可用额度大于等于零的，至次三个交易日起深交所可终止乙方报价回购业务权限，进入业务终止处理。

第四十二条 乙方发生以下情形之一的，深交所可终止其报价回购业务权限：

（一）乙方向深交所提出申请，终止其报价回购业务权限；

（二）乙方严重违反相关法律法规、中国证监会部门规章、《业务办法》及深交所和中国结算其他交易、登记结算业务规则；

（三）乙方进入风险处置或破产程序；

（四）乙方连续两个交易日无法完成资金划付；

（五）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乙方质押专用账户中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；

（六）深交所认定的其他情形。

第四十三条 进入业务终止程序后，甲乙双方同意按以下程序进行业务终止处理：

（一）进入业务终止程序当日，如甲方存在未到期回购的，乙方应及时通知甲方该项业务已经进入业务终止程序。

（二）进入业务终止程序当日，双方的所有未到期报价回购交易全部提前到期，并按本协议第四十九条的约定确定购回价格；乙方应及时向深交所及中国结算深圳分公司提交质押物处置申请。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物进行处置，处置所得与担保资金之和按债权比例优先向所有参与报价回购业务客户公平清偿。

（三）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业务，约定当终止当日出现未足额偿付且乙方怠于、不当或无法处置质押物的，

由该第三方代表甲方对质押物进行处置。质押物处置所得，按债权比例向客户公平清偿。甲方未获得足额偿付的，剩余债权仍由乙方对甲方承担全部法律责任。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。

(四) 甲方获得足额资金偿付的，则与乙方了清债权债务并应与乙方签署债务了结的确认函，确认其报价回购交易已结束。甲方委托乙方将其与乙方签署的确认函报送深交所，并向深交所申请解除质押登记。中国结算深圳分公司依据深交所通知办理相关质押登记解除业务。

甲方委托乙方向深交所提交的解除质押登记申请视为甲方向中国结算深圳分公司提交的解除质押登记的申请。

(五) 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。

第九章 异常情况处理

第四十四条 甲方待购回期间发生异常情况的，乙方有权及时上报深交所，异常情况包括但不限于：

- (一) 乙方质押专用账户内的质押份额被司法等机关冻结或强制执行的；
- (二) 乙方被暂停或终止报价回购业务权限的；
- (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机关冻结或强制执行的；
- (五) 质押券到期的。

发生上述第(一)、(二)、(三)项情形的，乙方应及时通知甲方。其中，乙方被暂停报价回购交易权限的，应在权限暂停之日开市前，通过其网站或系统进行公告；因乙方自身违法违规等原因导致上述情形，影响甲方正常交易的，乙方应按本协议约定向甲方承担违约责任。

第四十五条 甲、乙双方协商一致，甲方资金账户被司法等有权机关冻结或强制执行时，甲方同意并委托乙方对其报价回购按以下约定处理：

(一) 甲方资金账户被司法等有权机关冻结时，如甲方存在1天期报价回购，回购不再自动续做，如甲方存在7-91天报价回购，回购到期自然终止。

(二) 甲方资金账户被司法等有权机关强制执行时，如甲方存在1天期报价回购，回购不再自动续做，如甲方存在7-91天报价回购，回购视为提前购回处理，购回价格为每百元资金提前购回年收益。

第十章 违约处理与法律责任

第四十六条 本协议双方须严格、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。

第四十七条 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、终止协议等措施，并可以取消甲方报价回购交易注册客户资格，1年内不为其办理除集中竞价交易以外的任何交易业务。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、罚息、违约金、赔偿金和追索费用等。

第四十八条 甲方行为构成报价回购业务应付资金交收违约，乙方可以直接对甲方账户内资金或证券进行处分，包括但不限于限制取款和限制交易、冻结、强制平仓、扣划资金等，并自违约之日起每日按违约交收金额的万分之三向甲方收取违约金（深交所或中国结算深圳分公司有相关规定的，按相关规定执行），由此造成的全部损失，乙方有权向甲方追索。

第四十九条 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，甲方有权按以下约定要求乙方予以赔偿（本协议另有约定的除外）：

（一）因乙方违约造成甲方无法按时收到应收资金的，每延迟一天乙方按延迟交付金额的万分之三向甲方支付赔偿，除此以外乙方无需向甲方另行支付资金占用成本或其他任何形式的补偿、赔偿或违约金等。

（二）因乙方过错造成报价回购业务被中国证监会或深交所要求进入业务终止程序的，甲方持有未到期回购余额的收益，进入业务终止程序之前（含进入业务终止程序当日）按交易达成时约定的到期年收益率计算，进入业务终止程序次日起，每日按回购金额的万分之三计算，除此以外乙方无需向甲方另行支付资金占用成本或其他任何形式的补偿、赔偿或违约金等。

（三）非因乙方过错报价回购业务被中国证监会或深交所要求进入业务终止程序的，甲方持有回购余额的收益，按交易达成时约定的提前购回年收益率计算，直至乙方按业务终止程序向甲方偿付本息，除此以外乙方无需向甲方另行支付资金占用成本或其他任何形式的补偿、赔偿或违约金等。

第五十条 协议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。违反本规定给对方造成损失的应当承担赔偿责任。

国家有关部门依法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

第五十一条 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、电路故障等异常事故，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，其相应责任应予以免除。

第五十二条 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 利益冲突

第五十三条 甲方确认，在乙方为基金专户提供投资顾问服务，并作为投资者的交易对手及交易委托代理人，以及乙方子公司作为基金专户管理人并以其固有资金购买基金专户份额的情况下，乙方及其子公司承担的上述多重角色之间以及与其开展的其他相关业务（包括但不限于投资顾问、资

产管理、研究、证券承销与保荐、自营交易和经纪等)之间可能产生利益冲突,因此乙方在本协议项下的职责可能会与乙方的其他职责或利益产生冲突。

第五十四条 甲方确认,尽管存在或可能发生利益冲突,如乙方按照相关法律法规及监管要求从事以下服务、交易或行为且不利用甲方的保密信息,则乙方有权从事该等服务、交易或行为,甲方同意豁免乙方因此等利益冲突而导致的所有责任:

- (一) (以自营或其他方式)从事与甲方或第三方有关的任何交易;或者
- (二) 就任何事宜为其自身或第三方行事。

第五十五条 乙方确保:

(一) 乙方承接某一项目或业务(包括本协议事宜)的董事、监事、高级职员和雇员个人不受任何该等利益或职责冲突的影响;

(二) 乙方不会将甲方的任何保密信息披露或提供给任何其他客户。

第十三章 通知与送达

第五十六条 甲方依据本协议发出的所有通知,必须以书面方式作出并经乙方确认,否则视为无效。

第五十七条 乙方采用以下任一方式均视为有效的通知和送达:

(三) 乙方网站或证券营业部现场公告

乙方网站网址为: www.csc108.com; 公告发布起,视为通知已经送达。

(四) 电子邮件通知

乙方电子邮件发出至甲方邮箱时,即视为通知已经送达。

(五) 手机短信通知

乙方向甲方手机发送短信(含彩信),短信发出后即视为通知已经送达。

(六) 电话通知

乙方通过甲方固定电话或手机通知,通话当时视为通知已经送达。

甲方同意乙方对与履行本协议有关的电话内容进行录音,并且不必在每次打电话时征求甲方同意。双方认可该方式为正式合法有效的通知方式之一,不必附随以书面通知。

(七) 挂号信通知

乙方通过挂号信的方式根据甲方在本协议中提供的联系地址通知甲方,以寄出3日后视为通知已经送达。

第五十八条 乙方按照上述第五十七条中任何一种方式进行的通知,均视为乙方已履行通知义务(本协议特别约定的除外),同时视为甲方对乙方通知的内容已全部知悉。

第五十九条 甲方在本协议中提供的联系方式发生变化的,应在变化发生前及时告知乙方,否则应自行承担因延误告知所导致的后果。

第六十条 本协议除本章之外的其他条款约定具体的通知方式的,适用其约定。

第十四章 法律适用和争议的解决

第六十一条 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，若相关法律、法规、规章、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。

第六十二条 本协议根据法律、法规、规章、规则、深交所或中国结算深圳分公司相关业务指引等规定，如需修改或增补，修改或增补的内容由乙方在其营业场所或网站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，对甲方具有约束力。甲方不得以此认为乙方违反本协议或者对甲方构成侵权。

第六十三条 本协议执行中如发生争议，由双方友好协商解决。协商解决不成的，双方同意将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，依该仲裁委员会的仲裁规则进行仲裁，仲裁裁决是终局的，对双方均有约束力。甲乙双方因报价回购业务产生的任何争议、纠纷，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。

第六十四条 报价回购业务已进入业务终止程序的，甲乙双方一致同意，应当先履行本协议第八章所述的业务终止程序。业务终止程序履行完毕后，甲方仍未获得清偿的，方可将与乙方发生的争议提交本章所述仲裁委员会裁决。

第十五章 附则

第六十五条 甲乙双方与本协议生效前所作的任何说明、承诺、证明、意向或其它交易条件，无论是否已经双方口头或书面确认，自本协议签订后自行失效，有关约定均以本协议为准。

第六十六条 本协议经甲乙双方签署之日起生效。甲方为个人的，本协议由甲方本人签字；甲方为机构的，本协议由甲方法定代表人或授权代表签字，并加盖公章。

第六十七条 本协议发生下列情形之一时终止：

- (一) 甲方所有未到期回购已了结，申请取消本业务，经乙方同意的；
- (二) 甲乙双方协商一致终止本协议的；
- (三) 乙方被终止报价回购业务权限的。

本协议的终止不影响未了结的清算交收责任和有关争议解决条款的执行。

第六十八条 双方同意本协议不属格式合同。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。

第六十九条 本协议之补充协议及附件均为本协议不可分割的组成部分，具有同等的法律效力。

第七十条 本协议一式三份，甲乙双方各执一份，向深交所报备一份，均具有同等法律效力。

特别声明：

甲、乙双方确认，乙方已向甲方说明报价回购业务风险，并讲解本协议内容；甲方确认，甲方已经认真阅读并全面接受客户协议全部条款，已充分知悉、理解客户协议项下的权利、义务和责任，自愿参与报价回购交易，并承担由此产生的风险和法律后果。

甲方签章：

乙方盖章：

法定代表人签章：（机构户适用）

年 月 日

年 月 日