

东方财富证券股份有限公司

质押式报价回购业务客户协议

甲方

名称（姓名）：_____

证件类型：_____

证件号码/公司营业执照：_____

住所：_____

法定代表人：_____

联系方式：_____

乙方

名称：东方财富证券股份有限公司

注册地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

法定代表人：戴彦

联系方式：全国统一客服热线:95357

依据《中华人民共和国证券法》《中华人民共和国民法典》和《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》”）等其他有关法律、法规、规章及相关规定，甲乙双方就参与质押式报价回购交易及相关事宜，自愿达成如下协议，供双方共同遵守。

第一章 释义与定义

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/报价回购业务：即本协议所称“质押式报

价回购”或“报价回购”，指乙方将符合《质押式报价回购交易及登记结算业务办法》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，到期后依约向甲方返还融入资金并支付相应收益的特定质押式回购。

（二）标准券折算率：亦称“折算率”，指深圳证券交易所和中国结算认可的质押式回购标准券折算率。

（三）初始交易的申报价格：指每百元资金到期年收益。

（四）提前购回价格：指每百元资金提前购回年收益。

（五）提前购回：指甲方根据本协议的约定在回购到期日前终止回购交易。

（六）自动续做：对报价回购交易到期后下一期交易的达成方式，甲方可以选择自动方式。即在回购到期日，如果甲方未发出不再续做指令，则视为甲方自愿按剩余初始交易金额（不含回购收益）自动滚动续做原期限回购品种，甲方不需要下达回购初始交易委托指令，由系统自动完成续做回购初始交易。自动续做最小规模仍需应当满足参与本交易的最低限额。

（七）手动续做：对报价回购交易到期后下一期交易的达成方式，甲方也可以选择手动方式。即对于未选择自动续做的报价回购交易，在回购到期日，如果甲方希望参与下一期交易，应当再次下达回购初始交易委托指令，视为甲方自愿按剩余初始交易金额（不含回购收益）滚动续做原期限回购品种，由系统完成回购初始交易。

（八）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。对于一笔回购交易，甲方可以提出部分不再续做。

（九）天数：非特别声明为交易日的均指日历天数。

（十）深交所/交易所：指深圳证券交易所。

（十一）中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

（十二）交易日：指交易所的营业日。

（十三）证券登记结算公司/中国结算/中国结算深圳分公司：指中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司。

（十四）单期交易：指甲方在到期日不进行续做的报价回购交易。

（十五）多期交易：指甲方在到期日进行续做的报价回购交易。

（十六）初始交易金额：指甲方首次参与报价回购交易的金额。

（十七）剩余成交金额：指报价回购交易过程中初始交易金额减去提前购回金额的剩余部分。

第二章 声明与保证

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）甲方已仔细阅读本协议、《东方财富证券股份有限公司质押式报价回购业务风险揭示书》（以下简称“《风险揭示书》”）、《东方财富证券股份有限公司质押式报价回购交易产品资料概览》（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、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》的确切含义，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，愿意接受本协议的约束。

（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。

（六）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任何权利或义务；

（七）甲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，并经交易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）乙方的自有资产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它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 一般性约定

第四条 乙方具备开展报价回购交易资格，甲方与乙方进行报价回购交易，并委托及授权乙方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《业务办法》及其关于报价回购业务交易、登记结算等事宜的相关安排。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。

第五条 甲方参与报价回购业务，须通过乙方按其业务制度的规定所进行的资质审查，取得报价回购业务的注册投资者资格（以下简称“注册投资者资格”）。资质审查条件包括：开户时间、资产规模、信用状况、风险承受能力以及对证券市场的认知程度等。

本协议签署后，乙方将本协议提交交易所备案，备案成功后，乙方通知甲方取得注册投资者资格，甲方方可参与报价回购业务。甲方通过乙方的资质审查前，乙方将拒绝甲方的参与申请，甲方的有关委托指令视为无效。

第六条 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。甲方豁免乙方由此可能产生的利益冲突。

第七条 甲乙双方均确认，乙方向交易所进行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。

第八条 甲方进行报价回购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。甲乙双方一致同意，甲方资金不足的将无法参与报价回购交易。

第九条 甲方参与报价回购业务期间，不得撤销与乙方的托管关系，不得注销账户。甲方申请撤销、变更托管关系或注销账户的，乙方有权拒绝。

甲方提交报价回购委托后，不得向乙方申请撤销该申报委托；如甲方向乙方申请撤销已提交的委托，乙方有权拒绝，甲方仍应就该委托按约定承担相应责任。

第十条 报价回购经交易所确认成交后生效，生效后，除本协议另有约定外，甲乙双方必须承认交易结果，履行清算交收义务；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（提前购回的情形除外）。

第十一条 鉴于交易所目前对报价回购业务未收取任何交易费用，乙方暂不就报价回购业务向甲方收取佣金或交易费用。

如交易所报价回购业务规则变更，需收取相关交易费用时，乙方将按有关安排向甲方收取相关交易费用，收费办法以乙方的通知或公告为准。

如乙方需向甲方收取佣金的，需在交易发生前及时通知甲方，如甲方收到通知后还进行报价回购的，视为甲方同意乙方按通知的内容收取佣金。

第四章 双方的权利和义务

第十二条 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注册投资者资格后，可按本协议约定向乙方申请报价回购交易。

2、甲方有权按本协议约定向乙方或证券登记结算公司查询报价回购交易的相关信息。

3、有权按本协议约定申请提前购回。

4、有权按本协议约定申请不再续做。

5、有权收取报价回购收益。

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权利。

（二）甲方的义务

1、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、在乙方需收取交易费用和佣金时，按照本协议约定按时、足额向乙方支付应付报价回购交易对价、交易费用和佣金等。

4、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。

甲方提交报价回购委托后，不得向乙方申请撤销该申报委托；如甲方向乙方申请撤销已提交的委托，乙方有权拒绝，甲方仍应就该委托按约定承担相应责任。

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（包括但不限于新开报价回购、不再续做、提前购回委托或其他指令）均视为甲方行为，系基于甲方真实意愿作出；由于密码失密给甲方造成损失的，甲方自行承担全部损失和法律后果。

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、业务规则规定及本协议约定的其他义务。

第十三条 乙方的权利和义务

（一）乙方的权利

1、乙方有权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它相关文件，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。乙方依照乙方的业务制度规定对甲方进行资质审查，根据审查结果决定是否接受甲方进行报价回购。

2、有权设定具体产品是否支持提前购回、自动续做、手动续做，若具体产品不支持设置提前购回、自动续做、手动续做，则乙方有权拒绝提前购回、自动续做、手动续做申请。乙方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和提前购回委托。

3、当质押物折算后的标准券数量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。

4、在乙方需收取交易费用和佣金时，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。

5、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。

6、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。

甲方提交报价回购委托后，如甲方向乙方申请撤销已提交的委托，乙方有权拒绝。

7、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，保证报价回购业务规模不超过所提交的质押物经折算后的标准券总量对应金额。

5、在协议内容或有关业务规则变更后，及时通知甲方。

6、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，法律、法规、规范性文件或监管政策另有规定的除外。

7、乙方发生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。

8、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 质押物及质权

第十四条 乙方在中国结算深圳分公司申请开立“东方财富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“质押库”）和“东方财富证券股份有限公司质押式报价交易专用担保资金账户”（以下简称“担保资金账户”），用于保管乙方提交的拟用于质押担保的资产；乙方向中国结算深圳分公司申请开立“东方财富证券股份有限公司质押式报价回购专用处置证券账户”（以下简称“专用处置账户”），用于乙方质押物的处置。

乙方提交的作为报价回购交易质押物的自有证券应转入质押库。乙方提交的充当报价回购交易质押物的现金应存入担保资金账户。转入质押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。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。

第十五条 关于质押物的选择标准与担保价值计算。甲乙双方同意，可用作报价回购质押物的资产需经深交所和中国结算认可。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》；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，由交易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；以现金作为质押物的，标准券折算率为1。甲乙双方愿意承担由此带来的损失或风险。

第十六条 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。处置后所有客户未足额受偿的可继续向乙方追偿，处置后质押物有剩余的归乙方所有。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。

第十七条 证券登记结算公司受交易所委托根据成交结果及交易所确定的质押物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。对于已到期且已完成资金划付的回购交易，质押登记解除，乙方与甲方质押关系终止。

第十八条 甲乙双方参与报价回购业务，即视为双方认可《业务办法》关于质押物分配及质押登记等的相关规定。甲方委托乙方向交易所提交的报价回购交易申报即视为甲方向证券登记结算公司提交的按照《业务办法》规定办理质押登记的申请。

第十九条 乙方和证券登记结算公司提供的数据如有不一致的，

具体以证券登记结算公司质押登记数据为准。

第二十条 乙方应保证其质押库和担保资金账户中的质押物可以足额担保其所有未到期报价回购的债务。因质押物到期、价值波动、标准券折算率调整、司法冻结、司法扣划等任何原因导致报价回购质押物不足的，乙方应在次一个交易日内补足质押物，本协议另有约定的除外。

甲方已知悉并充分理解，乙方提交的、用于报价回购的质押物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。

第二十一条 乙方全部质押物经折算后的标准券总量对应金额大于未到期报价回购及到期资金划付失败的回购总余额的，甲方同意乙方可以向中国结算和交易所申请将超出部分质押物从质押库和担保资金账户中转出，并解除质押关系。

第二十二条 甲方如需查询其报价回购交易的相关情况，可向乙方或证券登记结算公司查询，包括乙方质押物经折算的标准券总量、乙方未到期报价回购总量、甲方未到期报价回购总量。

甲方参与报价回购交易，即表示其认可并自愿遵守《业务办法》关于质押物管理及质权设定的相关规定。

第六章 回购品种与交易

第二十三条 报价回购分为固定期限品种和灵活期限品种两类。固定期限品种暂时包括 1 天期、3 天期、7 天期、14 天期、28 天期和

91 天期 6 个品种(乙方可在交易所批准后将固定期限品种范围扩大),所有固定期限品种都可以选择到期续做。

灵活期限品种的期限可为一年以内的任意天数,由乙方根据汇总的需求临时开放,灵活期限品种不可以选择到期续做。

第二十四条 甲方卖出证券所得资金及报价回购到期并完成交收所得资金的当日,该类资金可以用于报价回购交易。

第二十五条 回购品种规模控制

乙方有权根据市场需求及回购额度,在每个交易日调整各个回购品种的规模上限。在任一交易日内,乙方可根据各回购品种的实时可用余额情况,拒绝甲方可能导致报价回购规模超限的委托,包括但不限于初始交易委托、续做委托。

甲方理解并认可,在甲方回购申报因乙方可用额度余额不足而被拒绝后,但因提前购回或不再续做交易导致额度释放,其后进行申购的投资者的申购委托可能会被乙方接受。

第二十六条 报价方式

乙方在每个交易日开市前通过自身网站及交易系统公布各固定期限回购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。甲方进行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。

乙方于每个交易日接受灵活期限回购品种的需求提交,并于汇总需求后设计、提供相应灵活期限品种,甲方可于此后的交易日进行该

特定品种的初始委托申报，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。

第二十七条 报价回购交易时间为交易日的 9:15 至 11:30,13:00 至 15:30。甲方的所有报价回购业务委托应当在交易时间内发出，乙方有权拒绝甲方在非交易时间或非约定时间内的委托。

第二十八条 报价回购交易的申报数量单位为张，1 张为人民币 100 元。对于固定期限品种，报价回购交易的初始最低申报数量为 10 张，超出部分以 10 张的整倍数增加。对其灵活期限品种，报价回购交易的初始最低申报数量为 100000 张，超出部分以 10 张的整数倍增加。

第二十九条 回购交易按日历时间计算收益。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。

第三十条 固定期限回购品种

（一）定义：1 天期、3 天期、7 天期、14 天期、28 天期、91 天期等回购品种是指回购期限分别固定为 1 天、3 天、7 天、14 天、28 天或 91 天等，申报价格以成交当天乙方公布的每百元到期年收益为准（提前购回的情形除外），回购期满后本息进行本息结算和支付的回购品种。

（二）交易过程

1、委托：甲方向乙方发出报价回购申购委托。甲方的申购委托指令主要包括以下内容：申报时间、合同序号（含乙方指定的交易单元代码、申报日期、甲方所在营业部识别码、申报流水号）、交易类

型、甲方证券账户号码、甲方交易单元代码、乙方指定的自营证券账户号码、证券代码、品种期限、到期回购日期、报价类型、初始交易申报价格、提前购回价格、申报数量、产品续做方式。乙方有权对各回购品种进行规模控制。在任一交易日内，若甲方的报价回购申购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交易所申报，并即时冻结甲方资金账户内的相应资金。

3、成交：成交申报经交易所交易系统确认，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、到期购回：在回购到期日，乙方根据本条第（四）项列明的回购到期金额计算公式逐笔计算购回总金额，并进行资金结算，客户资金当日可用。

5、提前购回：乙方有权设置产品是否可以提前购回，若具体产品可以提前购回，则甲方可在回购到期日前（包括回购成交日）向乙方发出提前购回委托，若具体产品不可提前购回，则甲方无权提出提前购回申请。1 天期产品不支持提前购回。提前购回的委托应当包括申报时间、合同序号（含乙方指定的交易单元代码、申报日期、甲方所在营业部识别码、申报流水号）、交易类型、甲方交易单元代码、甲方证券账户号码、乙方指定的自营证券账号号码、证券代码、品种期限、到期回购日期、报价类型、提前购回价格、数量、产品续做方式、对应初始交易的申报合同序号。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进行计算。对于一笔回购交易，甲方可以提出部分提前购回。

提前回购时间为每日 9:30-11:00，超过该时间的提前购回乙方有权拒绝。

在任一交易日内，若任一固定期限回购品种的当日累计提前购回委托总金额超过前一交易日日终该品种未到期余额的 30%，乙方有权不接受甲方提前购回委托申请。

6、巨额提前购回（固定期限品种）：指甲方当日固定期限品种的提前购回委托累计金额超过人民币 3000 万元（含 3000 万元）的行为。如果巨额提前购回没有在前一交易日 15:30 之前与乙方进行预约，乙方有权不接受甲方提前购回委托申请。

7、自动续做：乙方有权设置产品是否可以自动续做，若具体产品可以自动续做，则指甲方选择发出自动续做指令且自愿按剩余初始交易金额续做下一期交易，若具体产品不可自动续做，则甲方无权提出自动续做申请。在自动续做期间的回购视为按相同的交易期限、乙方每一到期日公布的报价自动达成下一期交易，甲方对该报价均予无条件认可和接受。自动续做的初始交易金额为上一期交易中扣除提前回购后的剩余初始交易金额，不包含上一期回购收益。

8、手动续做：乙方有权设置产品是否可以手动续做，若具体产品可以手动续做，则指甲方选择在回购到期日手动选择按剩余初始交易金额续做下一期交易，甲方选择手动续做应该再次向乙方发出初始委托，若具体产品不可手动续做，则甲方无权提出手动续做申请。在

手动续做期间的回购视为按相同的交易期限、乙方到期日公布的报价达成下一期交易，甲方对该期报价无条件认可和接受。手动续做的初始交易金额为上一期交易中扣除提前回购后的剩余初始交易金额，不包含上一期回购收益。

9、巨额不再续做：指甲方当日固定期限品种的不再续做委托累计金额超过人民币 3000 万元（含 3000 万元）的行为。如果巨额不再续做没有在前一交易日 15:00 之前与乙方进行预约，乙方有权拒绝不再续做委托。

（三）金额计算

1、初始交易金额=初始交易成交数量 $\times$ 100。

2、单期交易提前购回交易金额=提前购回成交数量 $\times$ （100+提前购回价格 $\times$ 实际回购天数/365）。实际回购天数=提前购回成交日对应的资金划付日-初始交易成交日对应的资金划付日。

3、单期交易到期购回金额=剩余成交数量 $\times$ （100+初始交易成交价格 $\times$ 实际回购天数/365）。剩余成交数量为，到期购回日该笔交易的初始交易成交数量减去对应的提前购回成交数量后的余量；实际回购天数=到期购回日对应的资金划付日-初始交易成交日对应的资金划付日。

（四）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、甲方在回购到期日做出提前购回的委托，将视为无效委托，乙方不予代理申报；

4、经交易所同意，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，如甲方对新品种提出申购委托的，甲乙双方权利义务适用本协议，法律法规或相关规则另有规定的除外。

第三十一条 灵活期限回购品种

（一）定义：甲方单笔回购交易参与金额超过 1000 万元（含 1000 万元），可以向乙方提出需求回购期限（一年以内的任意天数）、成交价格以双方协议的每百元到期年收益为准（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。

（二）交易过程

1、咨询：甲方提前向乙方提出灵活期限品种的需求，包括回购期限、初始交易价格、提前购回价格、金额等。

2、报价：乙方根据汇总的甲方需求及业务实际情况，设计灵活期限品种，制定各灵活期限品种的报价。乙方有权对各灵活期限回购品种进行规模控制。

3、委托：甲方向乙方发出特定灵活期限品种申购委托。甲方的申购委托指令主要包括下列内容：申报时间、合同序号（含乙方指定的交易单元代码、申报日期、甲方所在营业部识别码、申报流水号）、交易类型、甲方证券账户号码、甲方交易单元代码、乙方指定的自营证券账户号码、证券代码、品种期限、到期回购日期、报价类型、初

始交易申报价格、提前购回价格、申报数量、产品续做方式。

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

5、成交：成交申报经交易所交易系统确认，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。

6、到期购回：在回购到期日，乙方根据本条第（四）项列明的回购到期金额公式逐笔计算购回总金额，并进行资金结算，客户资金当日可用。

7、提前购回：甲方可在回购到期日前（包括回购成交日）向乙方发出提前购回委托。提前购回的委托应当包括申报时间、合同序号（含乙方指定的交易单元代码、申报日期、甲方所在营业部识别码、申报流水号）、交易类型、甲方交易单元代码、甲方证券账户号码、乙方指定的自营证券账号号码、证券代码、品种期限、到期回购日期、报价类型、提前购回价格、数量、产品续做方式、对应初始交易的申报合同序号。提前购回的，持有期收益按经交易所审批的该笔回购提前购回年收益率进行计算。对于一笔回购交易，甲方可以提出部分提前购回。

在任一交易日内，若任一灵活期限回购品种的当日累计提前购回委托总金额超过该交易日所有灵活期限回购品种实时未到期余额的30%，乙方有权不接受甲方提前购回委托申请。

8、巨额提前购回（灵活期限品种）：指甲方当日灵活期限品种的提前购回委托累计金额超过人民币3000万元（含3000万元）的行为。

如果巨额提前购回没有在前一交易日 15:00 之前与乙方进行预约,乙方有权不接受甲方提前购回委托申请。

(三) 收益计算

1、初始交易金额=初始交易成交数量 $\times$ 100。

2、提前购回交易金额=提前购回成交数量 $\times$ (100+提前购回价格 $\times$ 实际回购天数/365)。实际回购天数=提前购回成交日对应的资金划付日-初始交易成交日对应的资金划付日。

3、到期购回金额=剩余成交数量 $\times$ (100+初始交易成交价格 $\times$ 实际回购天数/365)。剩余成交数量为,到期购回日该笔交易的初始交易成交数量减去对应的提前购回成交数量后的余量;实际回购天数=到期购回日对应的资金划付日-初始交易成交日对应的资金划付日。

(四) 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、甲方在回购到期日做出提前购回的委托,将视为无效委托,乙方不予代理申报;

4、灵活期限品种不支持到期续做。

第七章 清算和交收

第三十二条 甲方参与报价回购交易,需使用其在乙方开立的客户资金账户办理与乙方之间报价回购交易的资金明细清算,并记载其

资金余额。

乙方应当通过其在中国结算深圳分公司开立的自营结算备付金账户和客户结算备付金账户进行报价回购交易的资金划付。

第三十三条 报价回购按照“一次成交、两次结算”的原则处理。

第三十四条 报价回购实行 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。

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，并将清算结果发送给乙方。

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。

证券登记结算公司完成乙方自营或客户专用资金交收账户内资金划付后，乙方与甲方之间报价回购交易的资金明细清算由乙方负责。乙方与甲方之间由于资金明细清算产生的法律纠纷与证券登记结算公司无关。

第三十五条 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支付违约金。

第三十六条 乙方报价回购业务被中国证监会或交易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）如果乙方在报价回购原约定到期日前（含当日）完成给甲方的资金支付，则按交易成交时约定的到期年收益率及期限计算收益；

（二）如果乙方在报价回购原约定到期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年收益率及期限计算收益外，乙方还应自原约定到期日起（不含当日）对应付金额按每日万分之三向甲方支付违约金。

第八章 异常情况的处理

第三十七条 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，乙方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。

第三十八条 乙方被暂停或终止报价回购业务权限。乙方被暂停报价回购业务权限的，乙方应及时通知甲方，并向深交所报告。当日不接受甲方的初始交易委托申请，但提前购回、到期购回业务不受影响，所有自动续做品种当日终止续做。乙方被终止报价回购业务权限的，如不能恢复，则按本协议第四十五条约定的业务终止程序处理。

第三十九条 乙方进入风险处置或破产程序，乙方应书面通知交易所和甲方，不再接受甲方新的委托；交易所终止乙方报价回购业务

权限的，按照业务终止程序进行处置。

第四十条 甲方资金账户被司法等有权机关冻结或强制执行的，乙方注销甲方的注册投资者资格并书面通知甲方，不再接受甲方新的委托，因此无法完成初始交易交收并造成乙方损失的，按本协议约定进行处理；造成到期购回交易无法交收的，乙方按照按交易达成时约定的到期年收益率和约定的期限支付甲方收益，从约定的到期日起，乙方按中国人民银行公布的活期存款利率计息，直至偿付甲方本息。具体偿付方式由甲乙双方另行协商确定。乙方向甲方支付足额偿付资金后，甲方应当签署报价回购业务终止确认函，确认其报价回购交易已结束。

第四十一条 乙方质押券到期的，乙方应在质押券到期前，用至少同等标准券数额的质押物置换出该部分将到期的质押券。

第四十二条 对于在报价回购业务初始交易中，乙方与证券登记结算公司间发生资金划付失败的，乙方将继续冻结甲方相应资金，于次一交易日再次进行清算交收。在资金划付成功之前，甲乙双方质押关系尚未成立，甲方该笔报价回购业务将暂时无质押物对应，但甲方资金收益不受影响。

第四十三条 对于在到期购回、提前购回交易中，乙方与证券登记结算公司间发生资金划付失败的，按如下方式处理：

（一）乙方应及时补齐应交收资金，于次一交易日再次进行清算交收。乙方应在次一交易日按中国人民银行公布的同期活期存款利率

计付给甲方利息，并对未交收资金金额按每日万分之三的标准给付甲方违约金。在资金划付成功之前，甲乙双方质押关系尚不解除。

（二）乙方如在次一交易日仍无法完成资金划付的，按照业务终止程序处置。

第九章 业务终止程序

第四十四条 报价回购业务出现下列情形之一时，进入业务终止程序：

（一）乙方违反交易及登记结算业务规则及相关法律法规，被交易所要求进入业务终止程序的；

（二）乙方进入风险处置和破产程序，被交易所要求进入业务终止程序的；

（三）乙方连续两个交易日无法完成资金划付，被交易所要求进入业务终止程序的；

（四）乙方因质押物到期、折算率调整、被司法冻结或扣划等原因导致质押物不足，且乙方未能采取有效措施使其报价回购可用额度不小于零，被交易所要求进入业务终止程序的；

（五）中国证监会、交易所要求乙方暂停报价回购业务，并要求乙方进入业务终止程序的；

（六）其他中国证监会、交易所要求乙方终止报价回购业务，进入业务终止程序的。

第四十五条 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，所有未到期报价回购均视为提前购回，回购价格为每百元提前回购年收益；

（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，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）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，由乙方对甲方承担清偿责任。

第十章 违约处理与法律责任

第四十六条 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，如发生违约行为，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、暂停甲方参与报价回购业务、终止协议等措施，并可以取消甲方注册投资者资格。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、交易费用、违约金、赔偿金、追索费用和发生的其他费用等。

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。

第四十九条 如因乙方过错导致进入业务终止程序的，乙方从原回购到期日开始每日按甲方未获偿付金额的万分之一向甲方支付违约金。非因乙方过错导致进入业务终止程序的，乙方无需承担责任。

第五十条 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，甲方有权要求乙方予以赔偿，但本协议另有约定的除外。

第五十一条 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。

国家有权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

第五十二条 因出现火灾、地震、瘟疫、社会动乱、特殊天气等不能预见、不能避免并不能克服的不可抗力情形，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。

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

第五十三条 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。

第五十四条 本协议如需修改或增补，修改或增补的内容由乙方在其营业场所或网站或通过交易系统以公告形式通知甲方，如甲方不同意乙方公告的修改或增补的内容，应在七日内向乙方提出书面异议；若甲方在七日内不向乙方提出书面异议，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。

第五十五条 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上海仲裁委员会，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。

其中，报价回购业务已进入业务终止程序的，甲乙双方一致同意，应当先履行本协议所约定的业务终止程序。业务终止程序履行完毕后，

甲方仍未获清偿的，方可将与乙方发生的争议提交本条所述仲裁委员会裁决。

第五十六条 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。

第十三章 附则

第五十七条 甲乙双方于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。

第五十八条 甲乙双方一致同意，乙方可以采用录音电话、传真通知、手机短信、邮件通知等通知方式向甲方发送通知等信息。

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。甲方同意，只要乙方通过本协议约定的通知方式中的任意一种方式向甲方发送了通知等信息，均视为乙方通知已送达甲方。如果非因乙方原因使得甲方未能收到上述通知，由此造成的后果及损失由甲方自行承担。

第五十九条 本协议经甲乙双方签署之日起成立并生效，发生下列情形之一时终止：

- （一）甲方（自然人）死亡或丧失民事行为能力；
- （二）甲方被人民法院宣告进入破产程序或解散；

（三）甲方未通过乙方的交易资格确认，或甲方情况发生变化，不再符合乙方认定的报价回购业务资质条件；

（四）甲方发生合并、分立、资产重组等重大事项，并严重影响其履约能力；

（五）甲方所有未到期回购已了结，申请终止本业务，经乙方同意的；

（六）甲乙双方协商一致终止本协议的；

（七）乙方被终止报价回购业务权限的；

（八）其他法定或者约定的协议终止情形。

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。

第六十条 当甲方为个人投资者时，本协议由甲方本人签署；当甲方为机构投资者时，本协议由甲方法定代表人或其授权代表签署，并加盖甲方公章。

第六十一条 本协议有效期一年。除非在协议有效期满前一个月内，甲乙双方中任一方书面通知对方协议有效期满时有效期不再延续，否则本协议有效期满后有效期自动延续一年，协议有效期自动延续次数不受限制。

第六十二条 本协议一式三份，甲乙双方各执一份，向交易所报备一份，均具有同等法律效力。

（以下无正文）

（本页无正文，为《东方财富证券股份有限公司质押式报价回购业务客户协议》签署页）

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。

甲方为个人投资者：

乙方法定代表人（或授权代表人）签字：

甲方签字：

乙方盖章：

日期：

日期：

甲方为机构投资者：

甲方法定代表人（或授权代表人）签字：

甲方盖章：

日期：

东方财富证券股份有限公司质押式报价回购 业务风险揭示书

尊敬的投资者：

质押式报价回购（以下简称“报价回购”）交易中存在风险，投资者在参与该业务前应审慎评估自身参与的适当性、合法性，并以真实身份参与。在决定进行报价回购交易前，投资者应充分了解该业务中存在的风险，包括但不限于以下内容：

一、报价回购交易具有市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、政策风险及其他各类风险。

二、在办理报价回购业务前，投资者应当根据自身的财务状况、实际需求、风险承受能力、以及内部管理要求（若为机构客户），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。

三、投资者在参与报价回购交易前，应了解东方财富证券股份有限公司（以下简称“东方财富证券”）是否已获得同意并开通报价回购交易权限。

四、在报价回购交易中，东方财富证券既是投资者的交易对手方，同时又接受投资者委托代为办理有关交易、登记结算等事宜，存在由此带来的利益冲突风险。

五、报价回购交易中，初始交易及购回交易中均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，相应的违约方应承担违约责任。

六、报价回购交易全部质押物设定的质权由东方财富证券所有报价回购未到期以及购回交易未完成交收的客户共同享有，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。当东方财富证券违约时，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。

七、东方财富证券报价回购交易权限终止后，将首先由东方财富证券根据《东方财富证券股份有限公司质押式报价回购业务客户协议》（以下简称“《客户协议》”）的约定对质押券进行处置，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。仅当东方财富证券怠于、不当或无法处置时，将由东方财富证券依据《客户协议》的约定委托进行质押券处置的机构对质押券进行处置。

八、东方财富证券与投资者已在《客户协议》中明确约定质押物选择与担保价值计算的依据，由此带来的损失或风险由投资者自行承担。

九、报价回购交易中，每个交易日报价回购可用余额是实时变化的。投资者发出的初始交易委托可能因可用余额不足导致委托失败，其他投资者在该投资者之后发出的初始交易委托却可能因可用余额增加而委托成功。

十、报价回购的收益由东方财富证券公布，投资者初始委托申报成功即视为同意并接受该收益。投资者已知悉并完全理解，该收益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。

十一、若市场发生变化，已达成的收益不会进行相应调整，投资者可能面临无法获取更高收益的风险。如投资者提前购回，东方财富证券将按照提前购回价格计算投资者的收益，由此可能带来一定损失。

十二、投资者有权按照协议约定进行交易品种的提前购回（含巨额提前购回）或不再续做（含巨额不再续做）预约，该预约不会自动转为正式的提前购回或不再续做指令。投资者应在预约的提前购回或不再续做日期的交易时间内，手动下达提前购回或不再续做指令，否则东方财富证券无法为投资者执行提前购回或不再续做，由此可能影响投资者的资金使用安排和流动性。

十三、报价回购发生巨额不再续做或巨额提前购回时，东方财富证券有权根据《客户协议》的约定拒绝未提前预约的巨额不再续做或巨提前预约的大额提前购回申请，可能影响投资者的资金使用安排和流动性。

十四、如投资者签署开通回购业务自动下单功能，系统于每个交易日 15 点自动申报回购业务，申报资金将无法参与 15 点后的交易，包括但不限于：国债逆回购、科创板、创业板、港股通、大宗交易、部分债券业务等。存在因资金先参与报价回购业务而无法参与其他业务的情形。投资者已知晓并自愿承担由此可能带来的损失。

十五、如果投资者同时签署开通“天天宝”等产品权限，若回购业务申请失败，资金账户内资金可能自动用于货币基金等其他产品投资，由此可能影响投资者的资金使用安排和流动性。

十六、如投资者已开通自动续作权限，东方财富证券有权根据市场行情变化决定每个交易日各交易品种的委托价格，投资者对各交易品种委托价格均予无条件认可，并授予东方财富证券代为申报。在自动续作期间，东方财富证券有权对可续作交易品种进行规模控制。在任一交易日内，若投资者的自动续作交易委托将导致可续作交易品种规模超限，东方财富证券有权拒绝。如投资者自动续作同一期限的交易品种时，新一期该交易品种的委托价格可能与上一期该交易品种的委托价格不同，投资者已知晓并自愿承担由此可能带来的损失。

十七、投资者在报价回购交易中面临交易对手信用风险，由此可能造成损失，导致无法偿还或无法足额偿还融资款项本息的风险，包括但不限于东方财富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，以及东方财富证券被暂停或终止报价回购权限、进入风险处置或破产程序等。

十八、投资者在报价回购交易中面临操作风险，由此可能造成损失，包括但不限于因东方财富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，以及因投资者原因没有及时了解相关通知信息等。

十九、在报价回购交易过程中，可能因为东方财富证券、交易所或证券登记结算公司的技术系统故障或者差错而影响交易的正常进行，导致投资者的利益受到影响。

二十、投资者应妥善保管资金账户卡、身份证件和交易密码等资料的安全，如投资者将证券账户、身份证件、交易密码等出借给他人使用，或因投资者原因导致上述资料泄漏，由此造成的风险由投资者承担。

二十一、在报价回购交易的存续期间，东方财富证券将以《客户协议》约定的通知与送达方式及通讯地址，向其发送通知。通知发出并经过约定的时间后，将视作东方财富证券已经履行对投资者的通知义务。投资者无论因何种原因没有及时知晓有关通知内容，由此产生的责任和风险由投资者自行承担。

二十二、在报价回购交易的存续期间，投资者联系方式发生变化，但未及时变更预留在东方财富证券的有效联系方式，导致东方财富证券无法通知其相关信息，由此产生的责任和风险由投资者自行承担。

二十三、投资者提交报价回购委托后，不得申请撤销该委托，投资者如因操作失误导致提交委托，无法通过撤单方式取消，可能会影响投资者的资金使用安排和流动性。

二十四、东方财富证券有权根据其业务制度规定对投资者的业务资质进行持续性审查，当投资者不符合业务资质时，东方财富证券有权终止投资者报价回购业务资格。

二十五、由于国家法律法规、相关政策和规则的变化、修改等原因，可能会对投资者的存续交易产生不利影响，甚至造成经济损失。

二十六、在报价回购交易的存续期间，如果因出现火灾、地震、瘟疫、社会动乱等不能预见、避免或克服的不可抗力情形，可能会给投资者造成经济损失。

二十七、报价回购业务已进入业务终止的，须先履行业务终止程序，业务终止程序履行完毕后，方可提交仲裁。

二十八、因报价回购业务产生的任何争议、纠纷，由投资者和东方财富证券双方协商或通过诉讼或仲裁等方式解决，与任何第三方无关，投资者不得就报价回购交易向任何第三方主张权利或追究责任。

二十九、可能存在因东方财富证券的业务或者财产状况变化导致投资者参与报价回购业务的本金或者原始本金亏损的事项，或可能存在因东方财富证券的业务或者财产状况变化影响投资者判断的事项。

三十、参与报价回购业务时存在限制投资者权利行使期限或者可解除合同期限等情况的相关事项包括但不限于投资者存在未到期报价回购交易的，公司将采取措施防范投资者进行撤销托管关系、注销账户等操作。

三十一、东方财富证券增加或减少报价回购业务固定期限的交易品种，增加或减少报价回购业务适用自动续作的交易品种的，将在其网站进行公告或直接在其交易系统中向投资者发送（包括但不限于弹窗提示、系统提醒、系统反馈或其他交易系统设置形式等），请投资者密切关注交易品种变化，以免影响交易安排。

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。投资者在参与报价回购交易前，应认真阅读相关业务规则及《客户协议》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。

本风险揭示书必须由投资者本人签署，当投资者为机构时，应由法定代表人或其授权代表签署并加盖公章。签署本《风险揭示书》表明投资者确认已知晓并理解《风险揭示书》的全部内容，愿意承担报价回购交易的风险和损失。

投资者：

法定代表人（授权代表）：

日 期：