

## 场外衍生品交易风险揭示书

尊敬的投资者：

为了使您更好地了解场外衍生品交易业务的风险，根据有关证券交易法律、法规、规章、规则、指引，特提供本风险揭示书，请认真详细阅读。

您于交易前应充分了解您的权利及义务，并审慎考虑自身之财务能力及经济状况是否适宜此种交易。在决定是否从事场外衍生品交易前，您应详读并了解下列各项场外衍生品交易的风险因素：

1. 场外衍生品特性风险：场外衍生品并不属于保本型金融商品，并不保证投资人在到期日时必定会收回原始投资金额或赚取任何固定收益。场外衍生品的报酬率主要取决于标的资产于交易契约到期日的结算价格，在标的资产走势不利的情况下，场外衍生品投资人可能面临重大损失，甚至变得毫无价值。

2. 买卖场外衍生品风险：买卖场外衍生品之亏损风险可以极大。在某些情况下，您所蒙受之亏损可能会超过投资本金。即使您设定了备用指示，例如“止损”或“限价”等指示，亦未必能够避免损失。市场情况可能使该等指示无法执行。您可能会在短时间内被要求追加履约保障品。假设未能在指定之时间内提供所需金额，交易相对人有权平仓，而您仍然要对本次交易任何因此而出现之 **亏损结果** 和欠缴数额负责。

3. 政策风险：场外衍生品是依据当前相关法规和政策所设计，如国家宏观政策以及市场相关法规政策发生变化，可能商品的受理、投资、偿还等的正常运行，甚至导致商品的收益降低。此外，场外衍生品交易属于创新业务，监管部门可视业务的开展情况对相关政策和规定进行调整，引起场外衍生品交易业务相关规定、运作方式变化或者证券市场波动，从而给投资者带来损失的风险。

4. 上市公司经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等会导致公司盈利状况发生变化。当场外衍生品交易的挂钩标的为上市公司的股票时，上市公司经营状况变化，发生长期停牌、合并、退市等异常事件，从而导致投资者收益不确定的风险。

5. 履约保障品被处置的风险：投资者应当按照双方签订的场外衍生品交易协议的相关约定履行权利、承担义务，当投资者违反协议约定时，本公司可以按照合同约定对投资者所提供的履约保障品作相应处置，从而导致投资者遭受损失的风险。

6. 投资者信用风险：投资者在从事场外衍生品交易期间，如果因自身原因导致信用状况严重恶化、出现丧失民事行为能力、破产、解散等协议约定的提前终止情形，投资者将面临因被本公司提前终止存续的交易而造成经济损失的风险。

7. 本公司不能履约的风险：本公司因停业、解散、撤销、破产，或者被有权机构撤

销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行场外衍生品交易中约定的义务，可能给投资者带来损失的风险。

8. 流动性风险：由于本公司所发行之场外衍生品并不具备充分市场流动性，投资人如遇有资金需求或其理财规划而需提前解约时，其解约日期将受限，投资人应自行考虑提前解约时本金、违约金损失之风险。

9. 利率风险：承作场外衍生品取得之交易价金若投资于固定收益商品时，其价格将受到利率走势影响。当利率上升，固定收益商品之市场价格将会下跌，而可能产生损失；若利率下降，固定收益商品之市场价格将会上涨。

10. 提前终止风险：根据某些交易合同的特性或受其他风险影响，本公司可能保留提前终止该交易合同的权利，其终止价格可能与投资人原先预估损益不尽相同。

**特别风险提示：某些衍生品交易，例如：期权交易，期权卖方很有可能遭受亏损无限放大的风险，请您在交易前熟悉相关交易规则，谨慎入市。**

本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明场外衍生品交易的所有风险。投资者在参与场外衍生品交易前，应认真阅读相关业务规则及协议条款，并对场外衍生品交易所特有的规则必须有所了解 and 掌握，并确信自己已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与场外衍生品交易而遭受难以承受的损失。请您应该仔细考虑自身财务状况、经验与目的确认是否合适进行此交易。

请您抄写以下划线内容：

本人承诺：已详细审阅本风险揭示书，已充分了解所揭示风险，并愿意独立承担该等风险。

本人承诺：已详细审阅本风险揭示书，已充分 ☐ ☐ 所揭示风险，并 ☐ ☐ ☐ ☐ 该等风险。

投资人盖章：

法定代表人或授权代表签字：

签署日期： 年 月 日