

《中国证券期货市场衍生品交易主协议》

补充协议

《中国证券期货市场衍生品交易主协议》补充协议

鉴于浙江南华资本管理有限公司（“甲方”）与_____（“乙方”）已签署《中国证券期货市场衍生品交易主协议》（以下简称“主协议”），为进一步明确各自的权利义务，双方特此签订本补充协议，作为主协议的组成部分。

主协议及本补充协议适用于交易双方以一对一方式达成的、按照交易双方的具体要求拟定交易条款的中国证券期货市场衍生品交易，针对单笔交易以签署《交易确认书》的形式确定。主协议、本补充协议、履约保障协议（若有）以及《交易确认书》统称本协议。除非交易双方另有书面约定，交易双方达成的其他交易不适用本协议。

主协议、本补充协议、履约保障协议（若有）以及《交易确认书》统称本协议。

第一条 违约和终止条款

1.1 主协议第 4.5 条中的“交叉违约”：

【√是】/【否】适用于甲方；

【√是】/【否】适用于乙方；

若甲乙双方均适用“交叉违约”，“交叉违约触发金额”为：

甲方、其履约保障提供方：甲方所有者权益的 10 %（以人民币计价）

乙方、其履约保障提供方：乙方所有者权益的 10 %（以人民币计价）

为免疑问，一方的所有者权益是指根据违约事件发生日上一年度的经审计财务报表确定的，并且该等经审计的年度财务报表符合其注册地公认的会计准则。

就乙方而言，若无上一年度经审计的财务报表，则触发金额为【50 万】元。

就交易一方、该方履约保障提供方而言，如果主协议第 4.5.1 条款所述累计违约金额少于交叉违约触发金额，并且主协议第 4.5.2 条款所述累计本金数额也少于交叉违约触发金额，但若上述累计违约金额与累计本金数额两者之和不少于交叉违约触发金额，则应被视为构成该方在主协议 4.5 条下的违约事件。

在判断主协议第 4.5.1 条所述累计违约金额和/或第 4.5.2 条所述累计本金数额是否超过交叉违约触发金额时，如果特定债务下的违约金额以交叉违约触发金额的计价货币以外的货币表示，则违约金额应按违约事件发生日中国人民银行公布或授权公布的人民币外汇牌价中间价转换为交叉违约触发金额的计价货币；对于中国人民银行日常未公布或授权公布人民币外汇牌价中间价的货币而言，应按违约事件发生日相关货币发行国的央行或类似授权政府机构公布的该种货币对美元或欧元的定盘价与中国人民银行公布或授权公布的相关人民币外汇牌价中

间价进行套算；如果通过上述方式仍不能确定相应转换汇率，则由守约方按相关市场惯例确定。守约方的换算或套算应按照诚实信用原则并以商业上合理的方式进行。

就上述任何一种中间价（或报价、牌价）而言，如果违约事件发生日上述公布机构未公布相应中间价（或报价、牌价），则违约事件发生日之前最近公布的中间价（或报价、牌价）应视为违约事件发生日公布的该等中间价（或报价、牌价），而不采用违约事件发生日当日其他机构公布的相应的中间价（或报价、牌价）。

“特定债务”

指：与任何款项的支付或偿还（无论是现有的、将来的、或有的或其他义务，也无论是作为主债务人或担保人或其他身份）相关的义务。就甲方而言，不包括甲方在其正常的业务经营过程中任何时候因为收取客户交易结算资金而发生的负债义务。

1.2 主协议第 4.7 条中的“特定交易下违约”：

【√是】/【否】适用于甲方；

【√是】/【否】适用于乙方；

“特定交易”

“特定交易”指甲方（或其履约保障提供方）与乙方（或其履约保障提供方）之间当前存续或今后达成的本协议管辖范围之外的：（1）以一对一方式进行的任何衍生产品交易；（2）以一对一方式进行的任何有价证券交易、融资交易及其他交易（包括该等交易的任何形式的组合）。

1.3 主协议第 5.1 条中的“自动提前终止”：

【√是】/【否】适用于甲方；

【√是】/【否】适用于乙方； 如果一个提前终止日因为“自动提前终止”适用于交易一方而被视为发生，**违约方**在此同意，将应**守约方**的要求，就股票价格、股票指数、利率、汇率、其他价格等**自提前终止日**始至**守约方**首次意识到提前终止日已经发生之日（“**决定日**”）为止的时间段内所发生的变动而导致**守约方**在有关交易下可能产生或遭受的一切损失与损害予以全部补偿。

如果**守约方**决定的结果是其就股票价格、股票指数、利率、汇率或其他价格等在**从提前终止日至决定日**之间所发生的变动而得到收益，该等收益直接归**守约方**所有不计入**提前终止**款项计算。

1.4 主协议第 6.2 条中的“因合并造成的资信降低”：

【是】/【√否】适用于甲方；

【√是】/【否】适用于乙方； 若适用，“**因合并造成的资信降低**”中的合并事件包括下述情形：

(a) 该方或其履约保障提供方发生分立，或与另一实体发生了联合、合并或兼并，或把自身的全部或大部分的资产转移到另一实体，或经重组、重设或改制纳入到另一实体或成为另一实体，或发生其他类似具有合并效果的事件；

(b) 任何人、任何相关团体或实体直接或间接地获得了：(i) 有权选举该方或其履约保障提供方的董事会（或同等权力机构）的大多数成员的股票的受益权；或(ii) 使其能对该方或其履约保障提供方实施控制的任何其他类型的所有者权益的受益权；

(c) 该方或其履约保障提供方通过发行或承担债务的方式或为债务提供担保的方式，使得自身的股本结构发生显著变化；或(i) 通过发行优先股或者发行可转换成或交换为债务或优先股的其它证券的方式，或(ii)（如该方或其履约保障提供方的组织形式并非采用公司形式）通过发行任何其他形式的所有者权益的方式，使得自身的股本结构发生显著变化的。

1.5 主协议第 6.3 条中的“其他终止事件”：

【是】适用于甲方；

【是】适用于乙方；

若适用，“其他终止事件”包括下述情形：

(1) 交易一方、其履约保障提供者由于法律法规或其适用的其他规范性文件的变动在应当履行义务或行使权利之时或在其他时候（假设该其他时候为应当履行义务或行使权利之时），导致该交易项下的支付或交付义务变得不合法，或收受关于该交易的款项或交付的实物变得不合法，或遵守关于该交易的主协议下的其他实质性条款变得不合法，或履行与该交易有关的履约保障文件约定的任何实质性义务变得不合法等事件；

(2) 业务资格丧失。交易一方丧失进行证券期货市场衍生品业务资格或其他从事本协议项下交易的必要资质。

(3) 市场禁入或限制。监管机构、自律组织出具的，禁止或限制交易一方从事本协议项下有关交易。

(4) 净资产降低。交易一方或其履约保障提供方最近年度的年度财务报告的净资产规模低于约定下限值。对交易一方而言，净资产规模的约定下限值为交易一方上一年度财务报表所列净资产的 70%，此处约定之“财务报表”指本补充协议第二条 3 款约定之财务报告的部分或全部会计文件，“上一年度”指交易一方“最近年度财务报告”的上一年度；对交易一方之履约保障提供方而言，净资产规模的约定下限值为该履约保障提供方上一年度财务报表所列净资产的 70%，此处约定之“财务报表”指本补充协议第二条 3 款约定之财务报告的部分或全部会计文件，“上一年度”指该履约保障提供方“最近年度财务报告”的上一年度；

(5) 一方业务、经营、资产、财务状况或其他状况发生持续重大不利变化导致履约能力下降或严重影响履约。

(6) 一方被相关行政机关或者监管机构立案调查或被相关行政机关或者监管机构给予重大行政处罚，交易继续存续不利于交易一方或双方。

(7) 若乙方为合伙企业，乙方的任一合伙人发生变化，包括但不限于退伙（包括《中华人民共和国合伙企业法》第四十八条规定的“当然退伙”的情形）、合伙人发生主协议第 4.6 条规定的任一事件或情形、合伙人之间和/或对外（向合伙人以外的个人、实体或其他第三方）转让其在合伙企业中的全部或者部分财产份额、任一合伙人减少对乙方的出资、普通合伙人转变为有限合伙人或者有限合伙人转变为普通合伙人、执行事务合伙人发生合并、分立、重组或转移其主要资产等情形严重影响乙方履约能力。

(8) 若乙方为自然人独资的一人有限责任公司，乙方股东向第三方转让或赠与其所持有的乙方部分或全部股权；或乙方股东死亡后，其股权由第三方继承等情形严重影响乙方履约能力。

上述“其他终止事件”的“受影响方”分别为：

(1) 由于法律法规或其适用的其他规范性文件的变动导致履行相关义务、协议条款变得不合法的交易一方、其履约保障提供方为“受影响方”。

(2) 业务资格丧失发生时，丧失业务资格的交易一方、其履约保障提供方为“受影响方”。

(3) 被监管机构、自律组织禁止或限制进行本协议项下相关交易的一方为“受影响方”。

(4) 净资产规模降低至低于约定下限值的一方为“受影响方”。

(5) 业务、经营、资产、财务状况或其他状况发生持续重大不利变化导致履约能力下降或严重影响履约的交易一方、其履约保障提供方为“受影响方”。

(6) 被行政处罚一方为“受影响方”。

(7) 第（7）（8）项的受影响方为乙方。

第二条 同意提供的材料

为主协议第 10.8 条的目的，乙方需于办理开户前提供以下材料，包括：

(1) 最近一次取得的营业执照、开户许可证复印件；

(2) 法定代表人身份证复印件；

(3) 授权有效的授权书和签字/签章样本；

(4) 若乙方为合伙企业，乙方应提供工商局备案的最新的合伙协议及其补充文件；

(5) 乙方最近一年的经审计的财务报表；

(6) 履约保障方（若有）身份证明文件；

(7) 若履约保障方（若有）为机构的，还应提供履约保障方权力机关签署的同意为乙方开展本协议项下衍生品交易提供履约保障的决议文件；

(8) 甲方要求的其他需要提供的材料。

如以上材料发生变更时，乙方应及时将变更后的文件提交给甲方。所有提供的文件均应当加盖乙方公章。如果乙方未及时提出书面变更通知的，视为乙方未变更。

交易存续期间，若甲方提出书面要求，乙方应当在收到该等书面要求之日起3个工作日内按照要求之规定向甲方提供乙方或其履约保障方（若有）的相关材料，若要求提供财务报告的，该等财务报告应当是按照注册地通用的会计准则编制经审计的最近半年度/年度财务报告复印件。

第三条 其他约定

3.1 通知方式

为主协议第 12.1 条的目的，甲方接收通知的方式指：

通信地址：浙江省杭州市上城区富春路 136 号横店大厦 6 楼 601。

收件人：场外衍生品部

邮政编码：310002

电话：0571-88843300

电子邮件：nanhuafdd@nawaa.com

微信号：

电子信息系统：无

为主协议第 12.1 条的目的，乙方接收通知的方式指：

送达地址：

收件人：

邮政编码：

电话：

电子邮件：

微信号：

电子信息系统：

甲方向乙方发送的通知，包括但不限于《交易确认书》、《盯市通知》、《追加履约保障品通知》、《结算通知单》等，均以**电子邮件**为主要通知方式，邮件通知一经送达乙方指定的邮箱地址即视为甲方履行了通知义务，交易期间乙方应及时查收电子邮件，未成功接收到通知邮件的须及时告知甲方重发。如果乙方接收邮件的邮箱地址发生变更，需**提前至少 3 个工作日书面通知**甲方，并以电话方式确认甲方收到此变更通知。若因乙方原因导致甲方的通知未能及时送达乙方的，乙方承担不利后果。

甲方以原件寄送、电话（短信）、微信、电子交易系统弹出通知等作为辅助通知方式，当电子邮件方式发生故障时，甲方可以选择方便乙方接收的辅助通知方式中的一种向乙方发送通知。

本合同载明的送达地址及联系方式适用于合同签订、履行及其可能的诉讼法院法律文书的送达。寄送至该地址的书面材料，无论收件方是否签收，均视为接收。送达地址、联系方式变更的，应书面通知对方，否则仍以原送达地址、联系方式为准。

3.2 通知生效时间 甲乙双方就通知生效时间达成以下一致约定：

以电子邮件方式发送的，应来源于双方约定的邮箱地址，内容完整，送达时间以进入成功对方邮件系统时间为准。

以微信方式发送的，应来源于双方约定的微信号，内容完整，送达时间以发送方的发送系统时间为准。

以电子交易平台提交的，送达时间以成功送达并进入对方系统时间为准。

若上述任何通知送达或接收的时间为**非接收方工作日**或为当日营业时间结束后，则相关通知的生效日为该日后的首个接收方营业日。

3.3 账户信息 甲乙双方收取履约保障品及权利金、结算金额等款项的账户信息如下：

（1）甲方的账户信息

甲方银行账户户名：浙江南华资本管理有限公司

甲方银行账户账号：9514 0154 8000 03398

甲方银行账户开户行：上海浦东发展银行杭州求是支行

甲方支付系统号：3103 3100 0156

（2）乙方的账户信息

乙方银行账户户名：_____

乙方银行账户账号：_____

乙方银行账户开户行：_____

乙方支付系统号：_____

交易一方需要变更其账户的，应不迟于相关付款日或交付日前的第5个营业日书面通知另一方。除非另一方在不迟于相关付款日或交付日前的第2个营业日就账户变更提出合理的反对意见，该账户变更生效。

若交易一方未按前述约定提前通知另一方而擅自变更账户，导致另一方未能及时履行主协议项下支付或交付义务的，另一方并不承担延迟履行的责任。擅自变更账户的一方也不得援引另一方未及时付款或交付而要求提前终止交易或主张违约救济。3.4 与主协议有关的“履约保障协议”指：

甲方与乙方或其履约保障提供方不时签署的履约保障协议、担保协议、保证合同、担保函等具有增强交易一方在本协议下履约能力的法律文件。

3.5 “履约保障提供方”

甲方的履约保障提供方指：【无】 乙方的履约保障提供方指：根据履约保障协议的约定为乙方向甲方提供履约保障的任何主体。

3.6 净额支付

主协议第 3.2 条“多笔交易的净额结算”适用于自主协议签署日期始的所有交易。

3.7 “电话录音”： 甲方可以对下述事项进行电话录音，并在不违反法律法规规定的前提下在争议解决过程中出具该等录音作为证据：

- (1) 确认交易；
- (2) 客户回访
- (3) 紧急情况下的电话通知；

(4) 双方认可进行录音的其他事项，包括但不限于：交易双方之间就本协议下交易或任何潜在交易进行的电话交谈。

3.8 “关联方”：【同主协议第十四条定义条款的含义】

3.9 其他陈述

为主协议第十条的目的，双方做出下述陈述：

(1) 不依赖。其自行独立决定进行交易，并且自行判断或在认为必要时听取顾问意见后自行决定该交易是否恰当或适宜。其并不依赖来自于另一方的任何（书面或口头的）通讯，并不以此作为投资意见或建议，其理解有关交易条款和条件的信息和解释不会被当作进行该交易的投资意见或建议。从另一方收到的任何（书面或口头的）通讯不会被视为对该交易预计效益的担保或保证。

(2) 评估和理解。其有能力评估该交易的价值，（自己或通过独立的专业顾问的帮助）有能力理解并且理解了该交易的条款、条件和风险。其有能力承担并且愿意承担该交易的风险。

(3) 其应遵守任何适用的法律法规，其确认违反该等法律法规将对其履行本协议下重要的义务造成重大不利影响；其应尽合理的努力获得且保有本协议所要求的一切必要的政府或其他监管机构的许可。

(4) 就其根据本协议规定需要向另一方交付的任何实物或支付的款项（为前款之目的，统称为“资产”）而言，在交付日时，其为该等资产的唯一所有人或

拥有交付和转让处分该等资产的完整合法权利，且该等资产未被设定任何担保物权、权益负担或其他限制。

(5) 不存在任何不利地影响其签署或履行本协议项下义务的涉及该方的诉讼、仲裁、强制执行或其它司法、行政程序。

(6) 保证开展的交易的资金来源及用途合法、合规；保证办理交易符合国家有关法律法规以及监管/主管部门的有关规定，并已经获得办理该笔交易的授权或者内部授权，不存在利用交易达到任何违背国家法律、法规、规章及规范性文件禁止性规定之目的。否则引起的任何法律或监管责任均由违法各方自行承担。

(7) 交易一方以自身名义、运用自有资金、且并非代表任何第三方或为开展基金或受托资产管理业务的目的从事本协议下的交易。

(8) 不存在利用衍生品交易从事规避法律法规相关要求及监管规定的违规行为。违规行为包括但不限于：利用交易进行标的证券/标的合约分仓以规避相关信息披露、交易限制、交易禁止等规定，利用交易影响、拉抬或打压标的证券/标的合约价格，利用交易规避其应当承担的信息报告、信息披露、要约收购等法定义务，利用交易进行内幕交易或操纵市场、洗钱、恐怖融资、利益输送；利用交易进行场外配资或杠杆投机，为他人提供通道；利用交易进行监管套利。

3.10 关于主协议第十三条第 13.7 款“保密”条款被如下条款替代：交易双方同意，对“甲乙双方为交易开展之需要向对方提供的有关财务、资产、客户、经营、产品等相关材料”以及“有关本协议以及本协议下交易的信息”应承担保密义务，除以下情形外，未经对方事先书面同意，不得向任何其他方披露：

(1) 交易一方按照法律法规、监管机构、行业自律组织的要求进行披露；

(2) 交易一方按照法院、仲裁机构或者任何司法程序的要求进行披露；

(3) 交易一方向其委托的会计师事务所、律师事务所、财务顾问等中介机构进行披露，但该方应促使该中介机构承诺承担保密义务。

(4) 交易一方同意另一方将有关本协议以及本协议项下交易的信息交流或披露予另一方的控股股东、分支机构或外部专业顾问。但无论如何，披露方应确保其控股股东、分支机构或外部专业顾问对所披露的信息承担保密义务。

(5) 本条不限制交易一方根据法律、交易所规则、自律组织规范的要求，就与本协议以及本协议项下交易有关的任何信息，向对披露方拥有管辖权、监管权力或监督权的任何法院、裁判机构、监管机构、政府机构、交易所、行业自律组织或公众，如实地进行信息披露。

在上述情形下，交易一方仅应提供法律法规、司法程序、监管机构、行业自律组织或者中介机构要求披露的那部分信息。

3.11 仲裁机构

由协议的订立、解释、履行、效力而引起的或与之有关的任何争议、纠纷或权利要求，双方应本着友好合作的原则，通过协商解决；协商应在一方向另一方

送达具体陈述和权利要求性质的书面协商请求后立即开始。如上述书面协商请求送达后 30 个工作日内未能进行协商或协商不成，双方中任何一方可将争议提交【杭州】仲裁委员会，按照其届时有效的仲裁规则仲裁解决。

双方同意仲裁庭由三人组成，双方各自选定一名仲裁员，并在仲裁规则规定的期限内由双方或双方各自选定的仲裁员共同选定一名首席仲裁员；如果双方或双方各自选定的仲裁员未能在规定期间内共同选定首席仲裁员，双方同意由杭州仲裁委员会主任代为指定一名首席仲裁员。

双方同意，双方因仲裁而提交或通过仲裁庭而交换的所有证据、文件、资料、陈述、中间裁决和最终裁决（以及该等裁决中所认定的事实），在仲裁期间和其后均承担保密义务。未经另一方书面同意，任一方不得直接或间接对任何第三方披露仲裁相关的信息和对仲裁进行评述。

仲裁过程中，除双方提交的争议事项外，双方应在协议的所有其他方面继续执行协议。

仲裁庭的裁决是终局的，对争议双方均有约束力。

3.12 营业日

【同主协议第十四条定义条款的含义】

第四条 交易流程

1. 交易申请

乙方提交交易申请（包括交易撤销申请和交易提前终止申请），应当确保内容表述清晰完整，并可采用电子邮件、微信、电话、电子交易平台（若有）等方式提交，提交时间应不晚于可提出该申请当日北京时间 14:30 前。除非经甲方书面同意，乙方的该等申请一经提交，不得修改。

乙方通过双方约定的电话确认方式提交的，送达时间以甲方完全理解并确认接受其指令为准。除双方另有约定，交易申请的生效时间适用 3.2 条“通知生效时间”的约定。

乙方在交易申请发出后，且该交易申请已经被甲方接受，且甲方已经在相关市场进行相关交易操作的，乙方不得撤销。

乙方有权提出提前终止申请，但甲方不保证提前终止时乙方可全额拿回初始履约保证金或权利金。提前终止之价格非使用到期报酬之计算方式计算，是利用提前终止当日终止净额加计甲方因避险所生之成本计算，甲方有权决定该提前终止之价格。乙方了解并同意于提出提前终止之申请时，将不会对甲方决定之提前终止价格提出异议。

2. 执行反馈与交易确认

甲方接受乙方的交易申请、并执行该申请后，于交易申请执行当日通过电子邮件、微信等方式向乙方反馈执行结果。乙方应当知晓，执行结果在不超出交易申请的范围内，实际成交均为有效。乙方对执行结果有异议的，最晚应于下一个交易时段开始前通过书面方式通知甲方，明确写明异议内容，同时电话告知甲方，否则视为无异议。若甲方在交易申请执行当日向乙方发送《交易确认书》，则可不再单独发送执行反馈。

甲方于交易执行之日起五个工作日内向乙方发送《交易确认书》，《交易确认书》可单独发送也可随每日盯市报告发送。

甲乙双方一致同意，《交易确认书》的发送时间不影响双方实际交易的达成。因业务需要，甲方有权单方调整的《交易确认书》最迟发送时间，但应当通过本协议约定的通知方式提前至少 2 个工作日书面通知对方。

3. 交易的盯市通知

以《交易确认书》约定的时间和方式为准。

4. 交易的结算

交易因正常到期或提出提前终止申请而终止。甲方应当于交易终止后以本补充协议约定的电子邮件方式向乙方发送《交易结算确认书》或《到期报告》或《清算报告》。

若乙方对《交易结算确认书》或《到期报告》或《清算报告》有异议的，应当于收到该文件起的下一交易日 17:00 前，通过约定通知方式书面写明异议内容并盖章。若乙方未在约定时间内以约定方式提出异议的，视为无异议。甲方收到乙方异议后应当予以复核，并于收到异议后的 1 个工作日内重新发送复核后的《交易结算确认书》或《到期报告》或《清算报告》。

对于复核后的《交易结算确认书》或《到期报告》或《清算报告》，乙方仍有异议的可以再次以约定方式提出，但不得以该异议为由拒绝履行支付义务。

5. 风险控制

乙方的履约保障价值比例低于《交易确认书》要求且未及时补足的，或者履约保障价值不足以全部覆盖乙方所有交易最大风险敞口且未按甲方要求及时补足的，或者按个别交易契约特性将会有重大风险影响的，甲方有权提前终止部分交易或全部交易。提前终止之结算由提前终止当日终止净额加计甲方因避险所生之成本计算。

6. 违约金

主协议第 9.2 条中发生或指定提前终止日的情形下，不计算支付和交付义务的利息；主协议第 5.3 条中所述计算报告中指定的提前终止款项付款日应不迟于计算报告生效日后的第 5 个营业日。如果乙方未按照计算报告中约定的付款日划拨款项，则乙方应向甲方除了支付该款项，还须按照逾期天数支付该款项的违约金。

逾期天数从计算报告中指定的提前终止款项付款日（含）起到实际付款日（不含）止。本补充协议约定的违约金为【日万分之五】。

若乙方发生违约，乙方同意甲方根据监管要求可将其相关信用风险信息报送至中国期货业协会。

第五条 补充协议的生效和修改

本补充协议一式二份，双方各执一份，每份具有同等法律效力。自双方签字盖章之日起生效。

经双方一致同意，可对补充协议以书面形式进行修改。书面方式不包括电子邮件或其他电子信息交换方式。

(以下无正文)

甲方：浙江南华资本管理有限公司

乙方：

(盖章)

(盖章)

授权代表签字：

授权代表签字：

授权代表职务：

授权代表职务：

日期：

日期：