



## 中国银河证券股份有限公司 质押式报价回购交易风险揭示书

尊敬的客户:

为了使您充分了解质押式报价回购(以下简称“报价回购”)业务风险,依据《中华人民共和国证券法》等相关法律、法规、规章和《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》”)、《关于调整债券质押式报价回购业务试点相关要求的通知》(以下简称《调整通知》)等上海证券交易所(以下简称“上交所”)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,特提供本风险揭示书,请认真详细阅读,慎重决定是否申请报价回购交易。

报价回购业务中存在各类风险,包括但不限于以下内容:

- 一、报价回购业务具有市场风险、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、您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制度(若为机构客户),慎重决定参与报价回购交易。
- 三、您在参与报价回购交易前,应了解中国银河证券股份有限公司(以下简称“银河证券”)是否具有开展报价回购业务的资质。
- 四、在报价回购交易中,银河证券既是您的交易对手方,同时又接受您的委托代为办理有关交易、登记结算等事宜,存在因银河证券内部控制疏漏所导致的利益冲突风险。
- 五、报价回购业务中,初始交易及购回交易中均可能出现因应付自营或客户专用资金账户资金不足额、资金划付通道不畅或其他原因导致资金划付失败、当日初始交易及到期购回的资金划付均延迟至次一交易日、当日初始交易在资金划付完成前没有质押券对应的情况。
- 六、报价回购交易全部质押券设定的质权由证券公司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,您所享有的质权不对应具体质押券品种,您不得单独就质押券主张行使质权。当证券公司违约时,全体质权人可以共同行使质权。质押券处置所得由客户按债权比例公平受偿。
- 七、每个交易日报价回购可用余额是实时变化的。您发出的初始交易委托可能因可用余额不足导致委托失败,其他客户在您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。
- 八、银河证券与您已在《质押式报价回购交易客户协议》(以下简称“《客户协议》”)中明确约定,双方同意,可用作报价回购质押券的证券符合相关业务规则,其中,债券对应的担保价值按照上交所委托中证指数有限公司提供的报价回购质押券折算率进行计算和调整,基金份额及上交所和中



国结算认可的其他证券作为质押券的,标准券折算率另行规定;上交所和中国结算可以根据市场情况调整质押券折算率管理的相关规定,并愿意承担由此带来的损失或风险。

九、报价回购的收益率由银河证券通过交易系统公布,您委托新开报价回购即视为同意并接受该收益率。您确认已知悉并完全理解,该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。

十、若市场利率发生变化,已达成的收益率不会进行相应调整,您可能面临无法获取更高收益的风险。

十一、报价回购发生大额不再续做、大额提前购回时,银河证券有权根据《客户协议》的约定拒绝不再续做或提前购回申请,可能影响您的资金使用安排和流动性。

十二、参与批量代理委托后,如需转出或取出资金,需于当日进行有效的报价回购预保留金额设置,否则可能影响您的资金使用和流动性安排。

十三、因交易所业务新增或调整,存在您原有适用于报价回购或其中批量代理委托的合格资金发生变化,出现无法参与相关业务的可能。

十四、乙方有权设置、调整或取消单资金账户批量代理委托的上限,上限金额以系统设置上限或乙方公告为准。

十五、为避免业务冲突,已申请了港股通权限,银河水星 1 号集合资产管理计划同类权限的投资者,将无法再申请本业务批量代理委托权限。如因业务新增或调整导致权限互斥业务有增加的,以乙方公告为准。

十六、发生标准券折算率调整、质押券到期、质押券被司法冻结或扣划等情形时,可能使得质押券不能足额担保银河证券履行所有购回义务。

十七、银河证券本身,存在因破产等非主观原因导致其无法偿还或无法足额偿还融资款项本息的风险。

十八、银河证券报价回购业务可能被暂停或进入业务终止,并可能因此不能及时、足额偿付您。

十九、银河证券、上交所、中国结算上海分公司等在业务操作过程中,可能因操作失误或违反操作规程而给您带来风险。

二十、请您妥善保管资金账户卡、身份证件和交易密码等资料,如您将证券账户、身份证件、交易密码等出借给他人使用,由此造成的后果由您承担。



二十一、在报价回购交易的存续期间，银河证券将以《客户协议》约定的通知与送达方式及通讯地址，向您发送通知。通知发出并经过约定的时间后，将视作银河证券已经履行对您的通知义务。您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您自行承担。

二十二、在报价回购交易的存续期间，您的联系方式发生变化，但未及时变更预留在银河证券的有效联系方式，导致银河证券无法通知您相关信息，由此产生的责任和风险由您自行承担。

二十三、由于国家法律、法规、政策、交易所规则的变化、修改等原因，可能会对您的存续交易产生不利影响，甚至造成经济损失。

二十四、在报价回购交易过程中，可能因为银河证券、上交所或中国结算上海分公司的技术系统故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致您的利益受到影响。

二十五、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，可能会给您造成经济损失。

二十六、报价回购业务已进入业务终止的，须先按《客户协议》约定履行业务终止程序，业务终止程序履行完毕后，方可提交仲裁。

二十七、因报价回购业务产生的任何争议、纠纷，由您和银河证券双方协商或通过仲裁方式解决，与任何第三方无关，您不得就本报价回购业务向任何第三方主张权利或追究责任。

二十八、在《客户协议》存续期间，若您存在违约情形，可能导致您被取消报价回购交易资格。

二十九、可能存在因本公司的业务或者财产状况变化导致您参与该业务的本金或者原始本金亏损的事项，或可能存在因本公司的业务或者财产状况变化影响您判断的事项。

三十、参与本业务时存在限制您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。

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。您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，掌握报价回购交易所特有的业务规则，并做好风险评估与财务安排，确定自身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/机构已认真阅读《客户协议》及本《风险揭示书》，知晓并理解所提示风险，确认自愿开通报价回购业务交易权限，并愿意承担报价回购业务的风险和损失。

客户签署：

日期：

(注：自然人投资者，请签字；机构投资者，请加盖机构公章或合同专用章并由法定代表人或其授权代理人签字)

公司