

协议编号：

客户代码：

上海质押式报价回购 客户协议



版本号：CHINAGALAXY-20211105

中国银河证券股份有限公司

上海质押式报价回购交易客户协议

甲方:

客户代码: _____

证件类型: _____

证件号码: _____

法定代表人 (仅限机构客户): _____

住所:

联系电话:

注: 甲方通过电子方式签署本客户协议的, 乙方将自动默认采用甲方在乙方开立的证券资金账户的个人信息作为本客户协议的个人信息, 甲方不同意上述方式的, 应当选择书面签署本客户协议。

乙方: 中国银河证券股份有限公司

法定代表人: 陈共炎

联系地址: 北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

联系电话: 4008888888、95551

为了规范甲乙双方开展的上海质押式报价回购 (以下简称“报价回购”、“报价回购交易”、“报价回购业务”), 明确甲乙双方在开展报价回购中的权利义务关系, 根据《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, 在平等自愿、诚实信用的基础上, 就甲乙双方开展报价回购相关事宜, 达成本协议, 供甲乙双方共同遵守。

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: 乙方将可用于上交所质押式回购交易的债券、基金份额或上交所、中国结算认可的其他证券作为质押券, 以质押券折算后的标准券总额为融资额度, 以乙方报价、甲方接受报价的方式融入资金, 在约定的购回日甲方收回融出资金并获得相应收益的交易。

(二) 标准券折算比率: 债券适用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; 以基金份额及上交所、中国结算认可的其他证券作为质押券的, 标准券折算率由乙方另行公告; 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。

(三) 初始交易: 甲乙双方之间进行的, 由乙方提供自有资产作为质押物, 向甲方融入资金的交易。

(四) 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。

(五) 初始交易日: 初始交易的日期。

(六) 购回日: 购回的日期, 包括回购到期日和提前购回日。

(七) 回购到期日: 报价回购按照约定期限正常到期的日期。

(八) 质押券: 乙方提交的作为报价回购交易履约担保, 并集中存放于乙方在中国结算上海分公司开立的“中国银河证券股份有限公司质押式报价回购质押专用账户”(以下简称“质押专用账户”)中的自有证券。

(九) 委托价格: 百元资金到期年收益, 单位为元, 精确到 0.01 元。

(十) 提前购回价格: 百元资金提前购回年收益, 单位为元, 精确到 0.01 元。

(十一) 提前购回: 甲方根据本协议的约定, 在回购到期日前终止报价回购交易。

(十二) 大额提前购回: 在任一交易日内, 若任一交易品种的当日累计提前购回委托总金额超过上一交易日该交易品种未到期余额的 30%, 或甲方当日提前购回委托单个交易品种的金额超过人民币 3000 万元的, 即认为该交易品种发生大额提前购回。

(十三) 自动续做: 甲方的交易品种、客户类型符合乙方公告中适用自动续做条件的, 相应交易品种回购到期日前, 如果甲方未发出不再续做指令, 即视为甲方自愿按原初始交易金额(不含到期收益)自动滚动续做同一期限的交易品种, 甲方不需要再下达初始交易委托。但在自动续做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, 甲方同意新一期该交易品种的委托价格以乙方在其交易系统公布的新一期该交易品种的委托价格为准。

(十四) 自动续做期间: 指甲方自愿按原初始交易金额自动滚动续做同一期限的交易品种的首日(含该日)至甲方发出不再续做指令之日(不含该日)的期间。

(十五) 不再续做(终止续做): 在自动续做期间, 甲方针对某交易品种发出不再续做委托指令, 该交易品种的自动续做功能立刻终止。对于单笔回购交易, 甲方不能提出部分不再续做。

(十六) 大额不再续做: 在任一交易日内, 若任一交易品种的当日累计不再续做委托总金额超过上一交易日该交易品种未到期余额的 30%, 或甲方当日不再续做委托单个交易品种金额超过人民币

3000 万元，即认为该交易品种发生大额不再续做。

(十七) 购回预约：甲方对其持有未到期的交易品种有提前购回（含大额提前购回）或不再续做（含大额不再续做）需求的，可以在乙方交易系统中对提前购回或不再续做进行预约，预约内容包括提前购回或不再续做的日期、金额、品种等。该预约不会自动转为正式的提前购回或不再续做指令，甲方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，否则乙方无法执行提前购回或不再续做。

(十八) 批量代理委托：指乙方交易系统于每一交易日 15:00 至 15:10 之间，根据报价回购委托规则，将甲方账户内可用于批量代理委托的全部或部分合格资金自动下达 1 天期交易品种（交易代码：205001）的初始交易委托。如甲方选择申请批量代理委托业务权限，即视为甲方同意授权乙方代理甲方将其账户内可用于批量代理委托的合格资金用于下达 1 天期交易品种（交易代码：205001）的初始交易委托，甲方无需另行下达委托指令。甲方在交易日 15:00 之前开通批量代理委托权限的，当日生效；在交易日 15:00 之后至下一交易日之前开通批量代理委托权限的，次一交易日生效。在甲方取消批量代理委托权限之前，乙方交易系统将持续对甲方账户内可用于批量代理委托的合格资金自动下达 1 天期交易品种（交易代码：205001）的初始交易委托操作。

(十九) 可用于批量代理委托的合格资金：指批量代理委托指令下达当日，甲方账户内未被司法冻结或扣划的可用于批量代理委托的资金，且资金数量最低不得少于 1000 元（含），最高不超过乙方当天设置的甲方资金账户的批量代理委托上限（含）。

可用于批量代理委托的合格资金金额= \min （甲方账户中上交所报价回购当日购回的可用资金+甲方账户中当日可取资金-批量代理委托用款设置的资金，乙方当天设置的甲方资金账户的批量代理委托上限），即可用于批量代理委托的合格资金金额按上述两个数值中较小者为准。

(二十) 批量代理委托用款设置（预保留资金）：甲方对用于批量代理委托的合格资金有其他用途的，甲方可进行批量代理委托用款设置（预保留资金），设置内容包括金额，开始日期和结束日期。

每个交易日 15:00 之前，批量代理委托用款设置和取消用款设置操作当即生效，否则将于次一交易日生效。批量代理委托用款设置在设置生效后，所设置的资金将自设置的开始日期（含该日）开始，至设置的结束日期（含该日）或甲方取消用款设置生效日（不含当日），持续不参与批量代理委托。

(二十一) 客户：指与乙方开展报价回购交易，已完成初始交易资金划付并且未完成购回交易资金划付的参与者的统称。

- (二十二) 交易日: 上交所的营业日。
- (二十三) 天数: 非特别声明为交易日的, 均指日历天数。
- (二十四) 中国证监会: 中国证券监督管理委员会。
- (二十五) 上交所: 上海证券交易所。
- (二十六) 中国结算: 中国证券登记结算有限责任公司。
- (二十七) 中国结算上海分公司: 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司。

第二章 声明与保证

第二条 甲方向乙方作如下声明与保证:

(一) 甲方具有相应的报价回购交易主体资格, 不存在有关法律、法规、规章、规则等禁止或限制其投资证券市场的情形, 并自愿遵守有关报价回购交易的法律、法规、规章、交易规则等的规定, 以及乙方制定的相关业务规定。

(二) 甲方保证参与报价回购业务的资金来源和用途合法, 并保证自愿遵守国家反洗钱相关规定。

(三) 甲方已仔细阅读本协议及其附件《质押式报价回购交易风险揭示书》(以下简称“《风险揭示书》”)的所有条款及内容以及《业务办法》、《调整通知》的规定, 听取了乙方对报价回购交易规则和本协议内容的充分说明, 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的免责条款的含义, 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业务, 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。

(五) 甲方承诺未经乙方书面同意, 不得以任何方式转让本协议项下的各项权利与义务。

(六) 甲方保证在本协议有效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与保证:

(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业务, 并经上交所批准开通了报价回购权限, 且该交易权限并未被暂停或终止。

(二) 乙方遵守有关报价回购交易的法律、法规、规章、交易规则等的规定, 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业务的必要条件, 能够为甲方进行报价回购交易提供相应的服务。

(五) 乙方自营证券账户内的自有证券在作为报价回购质押券提交时, 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) 乙方保证在本协议有效期内维持前述声明和保证始终真实有效。

第四条 甲、乙双方共同作如下声明与保证:

(一) 双方及其相关人员在履行本协议过程中, 不得向对方及其相关人员直接或间接提供或索取、接受对方及其相关人员直接或间接提供的包括但不限于下列形式在内的任何利益和方便:

1、接受或提供礼金、礼品、房产、汽车、有价证券、股权等财物, 或者通过代持方式接收财物或利益;

2、接受或提供旅游、宴请、娱乐健身、工作安排等利益;

3、接受或提供显著偏离公允价格的结构化、高收益、保本理财产品等交易;

4、直接或者间接利用他人提供或主动获取的内幕信息、未公开信息、商业秘密和客户信息谋取利益;

5、以诱导对方从事不必要交易等方式谋取利益;

6、开展违规交易、为规避违约处置提供便利、为利益输送或谋取不正当利益行为提供便利或从事相关行为;

7、其他输送或谋取不正当利益的情形。

(二) 不得有其他提供、索取或收受商业贿赂行为, 不得违反规定推荐其他相关合作方。

(三) 积极支持配合对方调查问题, 不得隐瞒、袒护对方及相关人员的不廉洁、商业贿赂行为。

(四) 双方应自觉注意和遵守其可能适用的任何司法管辖区关于反腐败和反贿赂的法律法规及/或可能适用的有关国际公约。

第三章 一般规定

第五条 乙方经中国证监会同意开展报价回购业务。甲方与乙方进行报价回购, 甲方委托并授权乙方办理报价回购的交易申报、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》的相关规定及关于报价回购业务交易、登记结算等事宜的相关安排。

第六条 甲方参与报价回购业务, 应通过乙方的资质审查。资质审查内容包括但不限于甲方的信用状况、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, 乙方将甲方相关资料提交上交所备案, 备案成功后甲方取得报价回购交易资格,

甲方可参与报价回购。在甲方取得报价回购交易资格前,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。乙方有权根据上交所要求调整资格审查内容和备案要求。

第七条 甲乙双方均确认:乙方向上交所进行的报价回购交易申报,均视为基于双方真实交易关系的申报。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 甲方已充分知晓并同意:甲方资金不足与乙方达成报价回购交易的,当日已达成的交易结果不变,但乙方有权于次一交易日提前购回或不再自动续做。

第九条 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,同时又代理甲方办理有关委托申报,并负责办理资金结算等事宜。

第十条 甲方未取得报价回购交易资格或者被取消资格后,与乙方达成报价回购交易的,已达成的交易结果不变,但乙方有权于次一交易日提前购回或不再自动续做;在甲方取得或者恢复报价回购交易资格前,乙方不接受甲方的初始交易委托,并不再为甲方自动续做。

第十一条 鉴于上交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。但如上交所报价回购业务规则变更,需收取相关费用时,乙方将按有关规则向甲方收取相关费用,收费办法以乙方的通知或公告为准。

第十二条 甲方同意乙方可以以电子信息(包括但不限于短信、微信、邮件等)的方式向甲方发送“质押式报价回购”相关的金融营销信息。乙方以电子信息方式向甲方发送“质押式报价回购”相关的金融营销信息时,应当明确乙方的真实身份和联系方式,并向甲方提供拒绝继续接收的方式。甲方有权根据自身需要选择拒绝继续接受乙方发送的“质押式报价回购”相关的金融营销信息。甲方确认并同意,乙方发送的“质押式报价回购”相关的金融营销信息内容仅供宣传或展示之用,不应视为任何要约,最终交易要素及最终成交情况应以乙方交易系统中的最终成交结果为准。

第四章 甲乙双方的权利和义务

第十三条 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,可按本协议约定向乙方申请报价回购交易。
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上海分公司查询其名下报价回购信息,未完成资金划付的初始交易除外。
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. 按本协议约定申请批量代理委托权限。
6. 按本协议约定申请购回预约。
7. 获取报价回购收益。
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权利。

(二) 甲方的义务

1. 甲方自行或委托乙方下达报价回购委托时应保证其资金账户中有足够的资金, 并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. 甲方保证在参与报价回购交易期间, 不改变证券账户指定交易关系。存在未到期回购交易的, 则甲方承诺不撤销、变更指定交易。甲方委托乙方申报撤销、变更指定交易的, 乙方有权拒绝。

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。

4. 按时、足额向乙方支付融出资金和交易费用(如有)。

5. 甲方对成交和清算交收有异议的, 应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均视为甲方行为, 系基于甲方真实意愿做出; 由于账户和密码保管原因、密码失密等原因给甲方造成损失的, 甲方自行承担全部经济损失和法律后果。

7. 对于大额提前购回或大额不再续做委托, 甲方应按约定提前预约, 否则乙方有权拒绝甲方的大额提前购回或大额不再续做委托。

8. 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。

9. 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。

第十四条 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它相关文件, 对相关内容进行解释或说明; 有权以合法方式对甲方的资信状况、风险承受能力以及履约能力进行必

要的调查。

2. 有权拒绝甲方发出的可能导致超限的委托或指令, 有权拒绝甲方非交易时间的委托, 并有权在乙方报价回购业务暂停期间拒绝接受甲方除提前购回和不再续做交易外的其他委托。

3. 当质押专用账户中质押券折算后对应的回购额度大于未到期报价回购的余额时, 可以将超出部分对应的质押券从质押专用账户中转出。

4. 按本协议约定向甲方收取报价回购交易的融出资金和交易费用(如有)。

5. 对于大额提前购回或大额不再续做委托, 若甲方未按约定进行提前预约, 乙方有权拒绝甲方的大额提前购回或大额不再续做委托申请。

6. 交易时间内发现甲方资金不足时, 因非正常原因(指系统缺陷、系统故障等)造成甲方初始交易指令被申报的, 乙方在上交所确认成交之前有权向上交所申请将相应的申报作废。

7. 报价回购交易存续期内, 甲方申请撤销、变更证券账户指定交易的, 乙方有权拒绝。

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权利。

(二) 乙方的义务

1. 除本协议另有约定外, 应及时、准确的执行甲方的委托指令。

2. 按时对报价回购进行清算, 并按照本协议约定向甲方支付收益。

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. 报价回购业务规模不得超过乙方所提交的质押券折算后的总额度, 但非因乙方原因导致的除外。

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、业务规则规定及本协议约定的其他义务。

第五章 质押券管理

第十五条 甲乙双方同意, 可用作报价回购质押券的证券包括可用于上交所质押式回购交易的债券、基金份额、上交所或中国结算认可的其他证券。

其中, 债券适用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, 基金份额及上交所或中国结算认可的其他证券作为质押券的, 标准券折算率适用上交所相关规定; 上交所、中国结算及

乙方可以根据市场情况调整质押券折算率。因质押券品种、折算率调整等带来的损失或风险由甲方承担。

第十六条 乙方在中国结算上海分公司开立质押专用账户,用以保管乙方提交的拟用于质押担保的质押券。乙方通过上交所交易系统将其持有的自有证券作为质押券申报转入质押专用账户。乙方提交的作为报价回购交易质押券的自有证券应转入其在中国结算上海分公司设立的报价回购质押专用账户,质押专用账户中的质押券作为乙方报价回购业务的履约担保物。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 转入质押专用账户中的证券作为乙方报价回购业务履约担保质押券。全部质押券设定的质权由初始交易完成资金划付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券品种,甲方不得单独就质押券主张行使质权,质押券处置所得由所有客户按债权比例公平受偿。

第十八条 甲方可向乙方或中国结算上海分公司查询报价回购相关信息,可查询的信息包括乙方质押券所折算的标准券总量、甲方未到期报价回购总量、乙方未到期报价回购总量。乙方与中国结算上海分公司的数据如有不一致,以中国结算上海分公司提供的数据为准。

第十九条 乙方保证质押专用账户中的质押券可以足额担保乙方履行其购回所有未到期报价回购的债务。质押专用账户中的质押券因折算率调整导致报价回购质押券不足,乙方最迟应于次一交易日内补足质押券。甲方已知悉并充分理解,乙方提交的、用于报价回购的质押券可能会因标准券折算率的调整、司法冻结、扣划等原因而不能足额担保乙方履行所有未到期的报价回购的债务。

第二十条 当质押专用账户中质押券折算后所对应的回购额度大于未到期报价回购的余额时,乙方可以向上交所申请将超出部分对应的质押券从质押专用账户中转出。乙方提交质押券转出申请,应确保质押专用账户内质押券数量及报价回购可用额度足额。质押券转出后,不再作为乙方报价回购交易的履约担保质押券。

第六章 交易品种与交易

第二十一条 甲方当日可取资金和当日上交所报价回购到期资金、当日终止续做资金和当日提前购回资金可用于当日报价回购交易。

第二十二条 交易品种分为1天(证券代码:205001)、3天(证券代码:205003)、7天(证券代码:205007)、14天(证券代码:205008)、21天(证券代码:205021)、28天(证券代码:205010)、35天(证券代码:205035)、42天(证券代码:205042)、63天(证券代码:205063)、91天(证券代码:205030)、119天(证券代码:205119)、154天(证券代码:205154)、182天

(证券代码: 205182)、210 天(证券代码: 205210)、245 天(证券代码: 205245)、273 天(证券代码: 205273)、301 天(证券代码: 205301)、357 天(证券代码: 205357)等。乙方有权根据交易规则调整交易品种,具体交易品种以乙方通知、公告或乙方交易系统设置公布为准,证券代码根据上交所规定编制。

第二十三条 报价回购额度

(一)上交所交易系统对乙方报价回购额度进行前端控制。回购额度为规模控制额度和质押专用证券账户中未被司法冻结或其他原因冻结的所有质押券经折算后的标准券总量所对应金额中的较小值,乙方保证其回购总额不得超过该额度。

(二)报价回购可用额度为乙方还可用于新增报价回购交易的总量或可转出的质押券折算后的标准券总量。报价回购初始交易完成或乙方提交质押券转出申报后,报价回购可用额度相应减少;提前购回交易完成后,报价回购可用额度相应增加。乙方提交报价回购初始交易申报,应确保报价回购可用额度足额。

第二十四条 交易品种规模控制

乙方有权根据市场需求及回购额度,在每个交易日自行确定各个交易品种的规模上限,并通过乙方交易系统或网站公布。在任一交易日内,乙方有权根据各交易品种的实时可用余额数据,拒绝可能导致规模超限的委托或指令。

甲方知晓并同意:乙方每个交易日报价回购可用余额是实时变化的。甲方发出的初始交易委托可能因乙方可用余额不足导致委托失败,其他客户在甲方之后发出的初始交易委托却可能因乙方可用余额增加而委托成功。

第二十五条 报价方式:乙方在每个交易日开市前,通过乙方交易系统公布各交易品种的百元资金到期年收益和百元资金提前购回年收益。甲方新开报价回购交易委托一经确认,即视为甲方同意并接受该百元资金年收益。甲方已知悉并完全理解,该交易日乙方交易系统公布的收益属于双方一致同意的约定收益,与其他市场利率可能存在偏差。

甲方已明确知悉并同意:乙方对质押式报价回购业务的各个交易品种可能会基于不同的申请渠道、定制化业务或提供其他附加服务等原因而提供差异化报价。当乙方对同一交易品种提供差异化报价时,甲方有权独立自主决策选择乙方对同一交易品种的报价,但甲方只能参与其中的一个报价,不得同时参与多个报价,并应签署甲方最终选择的报价对应的相关协议文件,开通报价回购业务权限。

甲方已明确知悉并同意:如甲方通过不同渠道或通过不同方式,均开通质押式报价回购业务权

限并参与报价回购交易，则甲方最终参与的渠道或方式、委托价格、信息公告方式等，以甲方在不同渠道或方式签署的相关协议中约定的内容为准。

甲方已明确知悉并同意：乙方通过其网站或其他形式（包括但不限于营销宣传海报、微信公众号、短信、邮件等）公布的各交易品种的百元资金到期年收益和百元资金提前购回年收益仅供参考，与乙方交易系统公布存在不一致的，以乙方交易系统公布的为准。

第二十六条 交易时间：交易日的 9:30 至 11:30, 13:00 至 15:10；提前购回委托时间为交易日的 9:30 至 11:30, 13:00 至 15:00。乙方可依据上交所时间的调整而调整。甲方的所有委托（提前购回委托除外）均应在交易时间内发出，乙方有权拒绝甲方非交易时间的委托。

第二十七条 交易最低限额：报价回购的委托数量单位为手。1 手=10 张=人民币 1000 元。最低申报数量为 1 手，超出部分以 1 手的整数倍增加。乙方交易系统设置以张为单位。

第二十八条 回购交易期限按日历时间计算收益。若到期日为非交易日，顺延至下一个交易日。

第二十九条 报价回购交易流程

（一）委托：甲方的委托包括但不限于初始交易委托、自动续做委托、不再续做委托、提前购回委托、批量代理委托或其他指令等。到期购回将在回购到期日自动操作，无需再另行下达指令。

甲方的委托指令主要包括下列内容：证券账户、证券代码、交易类型、委托日期、委托数量、委托价格、是否自动续做等。乙方有权对各交易品种进行规模控制。在任一交易日内，若甲方的交易委托将导致该交易品种规模超限，乙方有权拒绝甲方委托。

（二）自动续做

甲方的交易品种、客户类型符合乙方公告中适用自动续做条件的，甲方在发出报价回购初始交易委托指令时，若选择自动续做并经乙方交易系统确认后，在回购到期日前，如果甲方未发出不再续做指令，即视为甲方自愿按原初始交易金额（不含到期收益）自动滚动续做同一期限的交易品种，甲方不需要再下达初始交易委托。续做天数由甲方在发出初始交易委托指令时选择，但自动续做天数不超过乙方规定的天数（具体天数以乙方交易系统为准），自动续做最后一日为节假日的则顺延至次日交易。

乙方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，并通过乙方交易系统公布，甲方对各交易品种委托价格均予无条件认可，并授权乙方代为申报。在自动续做期间，报价回购委托价格为每次到期自动续做当日该交易品种甲方所接受的乙方报价。乙方有权对可续做交易品种进行规模控制。在任一交易日内，若甲方的自动续做交易委托将导致可续做交易品种规模超限，乙方有权拒

绝甲方委托。

甲方知晓并同意:如其自动续做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,甲方同意新一期该交易品种的委托价格以乙方在其交易系统公布的新一期该交易品种的委托价格为准。

(三) 批量代理委托

如甲方同意申请批量代理委托权限,在批量代理委托期间,甲方同意乙方于每一交易日 15:00-15:10 之间代理甲方对其账户内可用于批量代理委托的合格资金下达 1 天期交易品种(交易代码:205001)的初始交易委托,并于次一交易日到期购回,甲方无需另行下达委托指令。

批量代理委托期间,甲方每一交易日进行初始交易委托金额不得高于委托下达时甲方账户内可用于报价回购的合格资金余额。批量代理委托最低申报数量为 1 手,超过部分以 1 手的整数倍增加。1 手=10 张=人民币 1000 元,乙方交易系统中委托单位为“张”。批量代理委托的合格资金不足 1000 元的,乙方将拒绝甲方委托。

甲方知悉并同意,乙方有权单方设置、调整或取消任何一个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通知、公告或交易系统反馈为准。在批量代理委托期间,报价回购的 1 天期交易品种(交易代码:205001)委托价格由乙方根据市场行情变化决定,并通过乙方交易系统公布,甲方对该交易品种的委托价格无条件认可,并授权乙方代为申报。乙方有权对可进行批量代理委托的资金金额、客户类型等进行控制。在任一交易日内,若甲方的初始交易委托将导致批量代理委托的规模超限,乙方有权不执行甲方委托指令。

如果所有客户的可用于批量代理委托的合格资金金额总量超过乙方当日设置的批量代理委托总规模限制,则原则上按以下规则进行委托数量分配:

1. 将乙方当日设置的批量代理委托总规模按所有客户的可用于批量代理委托的合格资金金额总量比例分配至符合条件的客户,即分配至单个符合条件客户的委托数量=乙方当日设置的批量代理委托总规模÷所有客户的可用于批量代理委托的合格资金金额总量*单个客户的可用于批量代理委托的合格资金金额。分配至每一个客户的委托数量按交易最低限额向下取整,分配后甲方额度低于最低限额的,则不会执行任何委托指令。

2. 在上述操作完成后,如乙方当日设置的批量代理委托总规模还有剩余批量代理委托可用额度的,则乙方将对还有参与批量代理委托资格的所有客户随机分配剩余的批量代理委托可用额度,直至乙方当日设置的批量代理委托总规模的可用额度小于人民币 1000 元为止。

甲方知悉并同意,因乙方报价回购采取上述的批量代理委托分配规则,且由于总额度、具体品种

规模上限、交易所交易时间限制、随机分配等原因,乙方无法保障所有客户批量代理委托操作均能得到执行,甲方批量代理委托操作可能无法执行或仅部分执行。

(四) 回购到期: 在回购到期日,乙方根据本款列明的公式逐笔计算购回总金额,并进行资金结算,甲方资金当日可用。

甲方可在回购到期日前(初始交易日和回购到期日除外)向乙方发出提前购回指令。甲方提前购回的,持有期收益按该笔回购交易成交日乙方交易系统公布的百元资金提前购回年收益进行计算。对于单笔回购交易,甲方不能提出部分提前购回。

1. 到期购回的购回金额按如下公式计算:

购回金额=成交数量×(100元+百元资金到期年收益×实际回购天数/365)×10;其中,实际回购天数为成交日(含该日)起至回购到期日(不含该日)期间的日历天数,成交数量以手为单位。

2. 提前购回(包括大额提前购回)的购回金额按如下公式计算:

购回金额=成交数量×(100元+百元资金提前购回年收益×实际回购天数/365)×10;其中,实际回购天数为成交日(含该日)起至提前购回日(不含该日)期间的日历天数,成交数量以手为单位。

(五) 不再续做: 甲方于交易时间内发出不再续做委托,经乙方交易系统确认后当日生效,相应交易品种当期到期后则不再续做,回购到期日购回资金当日可用。甲方不能提出就某一交易品种部分不再续做。

(六) 批量代理委托用款设置(预保留资金): 甲方对可用于批量代理委托的合格资金有其他用途的,可通过“批量代理委托用款设置”进行设置。甲方设置有效的,设置的资金在设置的时间范围内不再属于可用于批量代理委托的合格资金。

(七) 申报: 乙方按照甲方委托的时间先后顺序及时向上交所申报,并即时冻结甲方资金账户内的相应资金。甲方资金账户内资金不足1000元导致无法冻结的,乙方有权拒绝甲方委托。最低申报数量为1手,超过部分以1手的整数倍增加。

(八) 成交: 成交申报经上交所交易系统确认,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。根据结算规则,经上交所交易系统确认成立的交易显示为“已报”。

(九) 其他约定

1. 报价回购交易成交后,甲方不得以任何理由撤销该报价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,乙方没有提醒甲方回购到期日的义务。

3. 甲方在初始交易日或回购到期日当日进行的提前购回委托,将视为无效委托,乙方不予申报

确认。

4. 报价回购交易 1 手=10 张=人民币 1000 元。

5. 经上交所同意,乙方可以增加固定期限的交易品种,可增加适用自动续做的交易品种等。上述调整由乙方在其网站进行公告或直接在其交易系统中向甲方发送(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),甲方应当密切关注交易品种变化,以免影响交易安排。相关交易品种同样适用本协议。法律法规或相关规则另有规定的除外。

6. 为避免业务冲突,已申请了大宗交易权限和银河水星 1 号集合资产管理计划等权限的投资者,将无法再申请报价回购交易“批量代理委托”权限。如遇业务新增或调整,导致时间冲突与权限互斥业务增加的,以乙方公告或乙方交易系统操作反馈为准。

甲方知悉,报价回购业务批量代理委托功能在每个交易日 15:00-15:10 与部分业务存在交易时间重叠,包括但不限于港股通、交易所质押式回购、科创板盘后固定价格交易等业务,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,甲方如需参与其他业务,应自行提前进行批量代理委托用款设置(预保留资金)或取消批量代理委托权限。

第七章 清算和交收

第三十条 报价回购交易按照“一次成交、两次结算”的原则处理。报价回购初始交易日,乙方根据成交金额进行首次清算;报价回购回购到期日,乙方按照成交记录自动进行到期清算(提前购回的情形除外)。

第三十一条 中国结算上海分公司每个交易日对乙方当日全部报价回购交易(包括但不限于报价回购初始交易、自动续做、到期购回、终止续做、提前购回和批量代理委托等)进行净额清算,并根据该净额清算结果,在乙方于中国结算上海分公司开立的用于结算的自营和客户专用资金交收账户(以乙方名义开立)之间进行资金划转。乙方相关专用资金交收账户应付资金不足的,当日全部报价回购资金划付均作失败处理。中国结算上海分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,甲乙双方之间报价回购交易的资金明细清算由乙方自行负责。甲乙双方之间由于资金明细清算产生的法律纠纷与中国结算及其上海分公司无关。

第三十二条 甲方对成交和清算交收有异议的,应在成交和清算交收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。

第三十三条 乙方无法完成当日报价回购资金划付的,乙方当日的报价回购新开回购交易、自动续做交易、批量代理委托交易、终止续做交易、提前购回交易及到期购回交易的资金划付全部延

迟至次一交易日。

对于资金划付延迟的新开回购交易、自动续做交易和批量代理委托交易，仍从上交所确认成交之日起计算实际回购天数，且回购到期日不变；对于资金划付延迟的终止续做交易、提前购回交易及到期购回交易，按照本协议第四十五条之约定计算违约金。

第八章 异常情形处理

第三十四条 乙方质押专用账户被司法等机关冻结的，乙方不再接受甲方新开回购交易委托、批量代理委托并终止甲方自动续做，甲方购回交易和终止续做不受影响。自乙方质押专用账户解除冻结之日起，乙方重新接受甲方新开回购交易委托、自动续做委托和批量代理委托。

乙方质押专用账户中的质押券被司法等机关冻结或强制执行的，乙方报价回购可用额度大于零且足以满足乙方客户全部自动续做的，甲方报价回购不受影响；否则，在满足前述条件之前，乙方不再接受甲方新开回购交易委托并终止甲方自动续做，但甲方购回交易不受影响。

第三十五条 乙方报价回购业务权限被暂停的，乙方不再接受甲方新开回购交易委托、批量代理委托并终止甲方自动续做，甲方购回交易和终止续做不受影响。若乙方由于报价回购可用额度小于零且未能及时采取有效措施使其报价回购可用额度大于等于零而被上交所暂停报价回购业务权限的，乙方有权根据《业务办法》的规定，向上交所申请提供自有资金账户中的现金作为临时质押物，使其报价回购可用额度大于等于零，中国结算上海分公司根据上交所确认将相关现金进行锁定。乙方可在采取其他措施使得报价回购可用额度大于零后，申请对多余现金解除锁定。

第三十六条 发生下列情形之一的，报价回购进入业务终止：

- (一) 乙方向上交所提出申请，终止报价回购业务权限；
- (二) 乙方发生《业务办法》规定情形，被上交所终止报价回购业务权限；
- (三) 乙方进入风险处置程序或破产程序，被上交所终止报价回购业务权限。

第三十七条 甲方知悉并同意，进入业务终止后，乙方可自行或委托第三方进行处置，甲乙双方同意按以下程序进行业务终止处理：

(一) 业务终止当日，甲方存在未到期回购的，乙方应采取电话、短信、电子邮件、传真、书面、网站公告等任一方式通知甲方报价回购业务已经进入业务终止；

(二) 业务终止当日，上交所将终止乙方的报价回购业务，并书面通知中国结算上海分公司于次一交易日起终止为乙方提供报价回购业务资金划付服务。乙方或乙方委托的第三方应当向上交所及中国结算上海分公司提交质押券处置申请，并按照价格公允、快速处置的原则对质押券进行处置，处置所得与质押现金之和按债权比例向客户公平清偿；

(三) 甲方收到足额偿付资金后, 应与乙方签署报价回购业务终止确认函, 确认报价回购交易已结束。乙方应将确认函报备上交所, 向上交所提交业务终止报告, 并可申请转出剩余质押券并对剩余质押现金解除锁定;

(四) 倘若质押券处置后仍存在未足额偿付的, 剩余部分应由乙方对甲方承担全部法律责任。

第三十八条 业务终止当日, 甲方所有未到期回购视为提前购回, 且乙方不得与甲方开展新的交易, 购回价格为每百元资金提前购回年收益, 购回金额按以下公式计算:

购回金额=成交数量×(100元+百元资金提前购回年收益×实际回购天数/365)×10; 其中实际回购天数为成交日(含该日)起至乙方进入业务终止之日(不含该日)期间的日历天数, 成交数量以手为单位。

第三十九条 甲方资金账户被司法等机关冻结或强制执行的, 导致甲方账户内资金余额不足的, 乙方有权拒绝甲方的新开回购交易委托, 但不影响已成交回购交易的清算交收。

第四十条 乙方质押券到期, 乙方应当替换到期的质押券。质押券替换后, 乙方报价回购可用额度大于零且足以满足乙方客户全部自动续做的, 甲方报价回购不受影响; 否则, 在满足前述条件之前, 乙方不再接受甲方新开回购交易委托并终止甲方自动续做, 但甲方购回交易不受影响。

第四十一条 发生《业务办法》规定的违约处置与异常情形时, 甲方获得足额资金偿付与乙方了清债权债务后, 应与乙方签署报价回购业务终止确认函, 甲方委托乙方将该确认函报备上交所, 向上交所提交业务终止报告以确认业务终止、向上交所申请解除质押登记。中国结算上海分公司依据上交所通知办理相关质押登记解除业务。

甲方委托乙方向上交所提交的解除质押登记申请视为甲方向中国结算上海分公司提交解除质押登记申请。

第九章 违约处理与法律责任

第四十二条 甲乙双方应严格、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。

第四十三条 甲方违反本协议相关条款约定的, 乙方有权采取提前购回、警告、责令改正、终止协议等措施, 并可以取消甲方通过乙方取得的报价回购交易资格。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、违约金、赔偿金和追索费用(律师费、保全费、保全担保费)等。

第四十四条 甲方行为构成报价回购业务应付资金交收违约, 乙方可直接对甲方在乙方处开立账户内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、强制平仓、扣划资金

等，并自违约之日起按相关规则的规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，给乙方造成的损失，乙方有权追偿。

第四十五条 甲方违反本协议相关条款约定，导致本协议全部或部分不能履行的，应当承担相应的法律责任。

因乙方过错（不可抗力、大额提前赎回等除外）造成甲方无法按时收到应收资金的，自逾期之日起，每延迟一天乙方按迟延金额的万分之三向甲方支付违约金。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。

第四十六条 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。违反本协议规定给对方造成损失的应当负赔偿责任。

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。

第十章 免责条款

第四十七条 因出现火灾、地震、疫情、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，其相应责任应予以免除。

第四十八条 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。

第十一章 法律适用和争议的解决

第四十九条 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（为本协议之目的，不含港澳台地区）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。

第五十条 甲方同意，如乙方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做的交易品种的，乙方将在其网站进行公告或直接在其交易系统中向甲方发送（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），不适用本协议第五十一条的规定。

第五十一条 除本协议另有约定外，本协议其他内容如需修改或增补，修改或增补的内容由乙方在其营业场所或乙方网站以公告形式通知甲方，若甲方在三个交易日内不提出异议，则公告内容即成为本协议的组成部分。甲方如不同意修改或增补后的协议，应于乙方公告内容正式生效之前，

进行提前购回及终止续做操作,并自行通过乙方交易系统取消其质押式报价回购交易权限。如甲方未在乙方公告内容正式生效之前取消其质押式报价回购交易权限,则视为甲方同意乙方的公告内容,双方将按照乙方新修改或增补后的协议执行。

第五十二条 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北京仲裁委员会,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的,甲乙双方一致同意,应当先履行本协议第三十七条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。

第五十三条 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仲裁方式解决,与任何第三方无关,甲方无权因本协议及报价回购业务向任何第三方主张权利或追究责任。

甲乙双方之间的纠纷,不影响中国结算上海分公司依据上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。

第十二章 附则

第五十四条 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。

第五十五条 甲方为个人客户的,本协议自甲方本人签字,乙方加盖印章之日起成立并生效;甲方为机构客户的,本协议自甲方法定代表人或授权代表签字或盖章并加盖印章,乙方加盖印章之日起成立并生效。

双方同意,甲方参与乙方报价回购业务可以采用电子签名方式签订本协议及其他相关文件。甲方通过身份验证登录乙方指定的网络系统,确认同意接受相关电子协议或文书的,视为签署协议,与在纸质协议上手写签名或者盖章具有同等的法律效力,无须另行签署纸质协议或文书。采用电子签名方式的,自甲方及乙方按照上述方式签章之日起生效。

第五十六条 本协议有效期一年。在本协议到期前一个月甲乙双方未书面通知对方到期终止协议的,本协议有效期自动顺延一年,以此类推。

第五十七条 发生下列情形之一时,本协议终止:

- (一) 甲方所有回购交易已了结,申请取消报价回购业务,经乙方同意的;
- (二) 甲乙双方协商一致终止本协议的;
- (三) 乙方报价回购业务终止的。

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。

第五十八条 本协议一式二份，甲方执一份，乙方执一份，均具有同等法律效力。

甲方已经认真阅读并全面接受本协议全部条款，已充分知悉、理解本协议项下的权利、义务和责任，自愿参与报价回购，并承担由此产生的风险和法律后果。

甲方（签字或盖章）： _____

法定代表人或授权代表签字或盖章（仅限机构客户）： _____

乙方：中国银河证券股份有限公司

乙方经办人： _____

乙方复核人： _____

本协议于 年 月 日签署。