

# 长江证券股份有限公司股票期权经纪合同

(版本号 QQ: 201912 版)

## 目 录

第一章 释义与定义.....	7
第二章 声明与承诺.....	10
第三章 开户.....	12
第四章 交易委托.....	15
第五章 结算.....	19
第六章 行权.....	22
第七章 风险控制.....	27
第八章 通知与确认.....	40
第九章 合同生效、变更与终止.....	41
第十章 免责条款与争议解决.....	43
第十一章 其他事项.....	45

# 长江证券股份有限公司股票期权经纪合同签署页

(合同编号\_\_\_\_\_)

甲方声明和签字:

兹证明本人/机构已仔细阅读并充分理解《长江证券股份有限公司股票期权经纪合同》，完全同意和接受该合同的全部条款和内容，自愿全面履行该合同的各项约定，享有和承担相应的权利和义务。

甲方基本信息			
姓名/名称		衍生品资金账号	
证件号码		证件类型	
法定代表人姓名 (机构)		授权代理人姓名及 身份证号(机构)	
移动电话		电子邮箱	
乙方基本信息			
名称	长江证券股份有限公司		
法定代表人	李新华		
住所地	武汉市新华路特8号	联系方式	95579

甲方签名/盖章:

乙方: 长江证券股份有限公司

机构客户法定代表人/授权代表:

乙方签章:

签署日期:       年    月    日

受理人:

## 投资者须知

### 一、投资者需具备的开户条件

投资者应是具备从事股票期权（以下简称期权）交易主体资格的自然人、法人或其他经济组织。

自然人申请开户时须是年满十八周岁、具有完全民事行为能力的公民。

投资者须以真实的、合法的身份开户。投资者须保证资金来源的合法性。投资者须保证所提供的营业执照、身份证及其他有关资料的真实性、合法性、有效性。

### 二、开户文件的签署

自然人开户的，必须由投资者本人签署开户文件，不得委托代理人代为办理开户手续、签署开户文件。法人、特殊法人、其他经济组织等机构投资者开户的，应当委托代理人办理开户手续、签署开户文件。

委托代理人开户的机构投资者应向公司提供真实、合法、有效的开户代理人授权委托书及其他资料。

### 三、投资者需知晓的事项

#### （一）知晓期权交易风险

投资者应知晓从事期权交易具有风险。投资者应在开户前对自身的经济实力、产品认知能力、风险控制能力、生理及心理承受能力等做出客观判断，应仔细阅读并签字确认《股票期权风险揭示书》。

#### （二）知晓期权经营机构不得做获利保证

投资者应知晓期权交易中任何获利或者不会发生损失的承

诺均为不可能或者是没有根据的，期权经营机构不得与投资者约定分享利益或共担风险。

### （三）知晓期权经营机构不得接受投资者的全权委托

投资者应知晓期权经营机构及其工作人员不得接受投资者的全权委托，投资者也不得要求期权经营机构或其工作人员以全权委托的方式进行期权交易。全权委托指期权经营机构代投资者决定交易指令的内容。

### （四）知晓投资者本人须对其代理人的代理行为承担民事责任

投资者代理人是基于投资者的授权，代理投资者实施民事行为的人，代理人在代理权限内以投资者名义进行的行为即视为投资者自己的行为，代理人向投资者负责，投资者对代理人代理行为的后果承担一切责任。

### （五）知晓期权保证金安全存管的有关规定

为保障期权保证金的安全，投资者应当知晓并遵守中国证监会有关期权保证金存取的规定，应当确保将资金直接存入期权经营机构的客户保证金账户，期权保证金的存取应当通过投资者在期权经营机构登记的期权银行结算账户和期权经营机构的客户期权保证金账户之间转账办理。

### （六）知晓期权保证金账户和结算资料的查询网址

投资者知晓其期权保证金账户和结算资料的查询网址为：  
([www.sipf.com.cn](http://www.sipf.com.cn)) 或者 ([www.cfmcc.com](http://www.cfmcc.com)) (二者选其一)。

### （七）知晓从业人员资格公示网址

有关从业人员的信息可以通过中国证券业协会网站

([www.sac.net.cn](http://www.sac.net.cn))、中国期货业协会网站([www.cfachina.org](http://www.cfachina.org))进行查询。

#### (八) 知晓应当妥善保管密码

投资者应当妥善保管自己的交易密码、资金密码、期权保证金安全存管监控机构密码及其他与期权交易相关的密码,凡使用密码进行的所有操作均视为投资者本人的操作,投资者必须承担由于管理不善造成密码泄密所带来的损失。

#### (九) 知晓并遵守证券交易所有关异常交易、实际控制关系账户的规定

投资者应当知晓并遵守证券交易所对自买自卖、频繁报撤单及其他异常交易行为和实际控制关系账户的有关规定。

投资者违反上述规定,经期权经营机构提醒、劝阻、制止无效时,期权经营机构有权采取提高保证金、限制开仓、强行平仓、限制出金、拒绝投资者委托或者终止经纪关系等措施,由此造成的一切损失,均由投资者承担。

#### (十) 知晓反洗钱法律法规的有关规定

投资者应当知晓不得利用期权账户从事洗钱活动,知晓期权经营机构作为金融机构承担反洗钱义务,投资者应积极配合期权经营机构开展反洗钱工作,包括但不限于投资者身份识别、可疑交易报告、风险等级划分、账户实际控制关系申报等。

投资者存在洗钱行为的,需要承担法律责任,构成犯罪的,将被追究刑事责任。

#### (十一) 知晓投资者适当性制度的有关规定

期权经营机构根据法律、法规、规章、证券交易所、中国证

券登记结算有限责任公司以及其他行业自律机构的业务规则的各项要求，对投资者进行适当性评价。评价结果不构成对投资者的投资建议，不构成对投资者的获利保证。

投资者应当根据投资者适当性管理制度的要求及自身的风险承受能力，审慎决定是否参与期权交易，不得以不符合适当性标准为由拒绝承担期权交易结果与履约责任。

以上《投资者须知》的各项内容，本人/单位已阅读并完全理解。

**自然人投资者**

甲方（签字）：

**机构投资者**

甲方名称：

（加盖公章）

委托代理人：

（签字）

签署日期：\_\_\_\_\_年\_\_\_\_月\_\_\_\_日

# 长江证券股份有限公司股票期权经纪合同

依据《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国合同法》、《证券公司监督管理条例》等法律、法规，中国证监会部门规章及其他规范性文件，证券业协会、证券交易所和证券登记结算机构制定并实施的相关业务规则，以及乙方制定的相关业务制度的规定，甲乙双方本着平等自愿和诚实信用的原则，就乙方为甲方提供股票期权（以下简称期权）交易经纪服务的相关事宜，达成本合同，供双方共同遵守。

## 第一章 释义与定义

**第一条** 除非本合同另有解释或说明，下列词语或简称具有以下含义：

- 1、交易所：是指上海证券交易所和深圳证券交易所。
- 2、中国结算：是指中国证券登记结算有限责任公司及其分公司。
- 3、交易日：是指交易所的正常营业日。
- 4、合约标的：指期权交易双方权利和义务所共同指向的对象。股票期权合约标的是指在交易所上市挂牌交易的股票或者交易所交易基金。
- 5、权利金：指期权权利方向义务方支付的用于购买期权合约的对价。
- 6、行权价格：指期权合约规定的、在期权买方行权时买入、

卖出合约标的的交易价格。

7、合约单位：指单张合约对应的合约标的的数量。

8、认购期权：指期权权利方有权在特定日期以行权价格买入约定数量合约标的的期权合约。

9、认沽期权：指期权权利方有权在特定日期以行权价格卖出约定数量合约标的的期权合约。

10、衍生品合约账户：指记录甲方股票期权持仓合约的账户，用于期权开平仓和行权申报，与甲方现有 A 股证券账户一一对应。

11、衍生品资金账户：指甲方股票期权等衍生品保证金的存放账户，用于权利金及行权资金的交收，该账户为新开账户。

12、维持保证金：指甲方存入保证金账户，用于担保合约履行且已被合约占用的保证金。

13、开仓保证金：指乙方对每笔卖出开仓申报实时计算并对有效卖出开仓申报实时扣减的保证金日间额度。

14、实时价格保证金：指乙方盘中按合约标的最新成交价格 and 期权合约最新成交价格计算的甲方所需保证金金额。

15、保证金开仓：指甲方使用保证金作为履约担保，卖出认购期权或认沽期权。

16、备兑开仓：指甲方在拥有足额标的证券的基础上，卖出相应数量的认购期权。

17、平仓：指甲方进行反向交易以了结所持有的合约。

18、强行平仓：是指当甲方未能按规定补足保证金或发生本合同约定的其他需要强行平仓的情况时，乙方对甲方衍生品合约账户内的期权合约进行处置的行为。

19、实时风险值 1：指按照乙方确定的保证金水平计算的甲方实时价格保证金/甲方保证金总额。

20、实时风险值 2：指按照交易所和中国结算确定的保证金水平计算的甲方实时价格保证金/甲方保证金总额。

21、维持保证金比例 1：指按照乙方确定的保证金水平计算的甲方维持保证金/甲方保证金总额。

22、维持保证金比例 2：指按照交易所和中国结算确定的保证金水平计算的甲方维持保证金/甲方保证金总额。

23、占用未对冲开仓保证金：按照开仓保证金公式并按乙方设立的收取水平计算的，以合约标的前收盘价和合约前结算价计算且为甲方已成交和已申报开仓未成交的期权义务仓合约（对双向持仓不进行对冲）所占用的保证金。

24、占用未对冲实时价格保证金：按照开仓保证金公式并按乙方设立的收取水平计算的，以合约标的最新价和合约最新价计算且为甲方已成交和已申报开仓未成交的期权义务仓合约（对双向持仓不进行对冲）所占用的保证金。

25、本合同所称“超过”、“高于”、“低于”“不足”不含本数，“达到”、“以上”含本数。

## 第二章 声明与承诺

**第二条** 乙方向甲方作如下声明和承诺：

1、乙方是依法设立的期权经营机构，具有相应的期权经纪业务资格；

2、乙方具有开展期权经纪业务的必要条件，能够为甲方的期权交易提供相应的服务；

3、乙方承诺遵守有关法律、法规、规章、交易所以及中国结算业务规则，不接受投资者的全权交易委托，不对投资者的投资收益或亏损进行任何形式的保证，不编造或传播虚假信息误导投资者，不诱使投资者进行不必要的期权交易；

4、乙方承诺遵守本合同，按本合同为甲方提供期权交易经纪服务。

**第三条** 甲方向乙方作如下声明和承诺：

1、甲方具有合法的期权投资资格，不存在法律、法规、规章、交易所及中国结算的业务规则禁止或限制其进行期权交易的情形；

2、甲方保证在其与乙方本合同关系存续期内向乙方提供的所有证件、资料均真实、准确、完整、合法，并保证其资金来源合法；

3、甲方已阅读并充分理解乙方向其提供的《股票期权风险揭示书》、《投资者须知》，清楚认识并愿意承担期权市场投资风险；甲方已详细阅读本合同所有条款，并准确理解其含义，特别

是其中有关乙方的免责条款；

4、甲方承诺遵守有关法律、法规、规章、交易所及中国结算的业务规则，遵守乙方投资者适当性管理相关制度和要求；

5、甲方承诺遵守本合同，并承诺遵守乙方的相关管理制度。

**第四条** 甲方委托乙方从事期权交易，保证所提供的证件及资料具有真实性、合法性及有效性。甲方声明并保证不具有下列情形：

（一）无民事行为能力或者限制民事行为能力的自然人；

（二）中国证监会及其派出机构、中国期货业协会、中国证券业协会、交易所、中国结算、期权保证金安全存管监控机构、期权经营机构的工作人员及其配偶；

（三）国家机关、事业单位；

（四）证券、期货市场禁止进入者；

（五）未能提供真实、合法、有效开户证明文件的单位或个人；

（六）中国证监会及交易所规定不得从事期权交易的其他单位或个人。

如果以上声明部分或全部不真实，甲方承担由此产生的全部法律责任并自行承担由此造成的一切损失。

**第五条** 在本合同关系存续期间，甲方提供给乙方的身份证明文件过期、身份信息发生变更或者风险测评有效期过期的，甲方有义务及时通过乙方提供的方式变更留存在我司的材料或信

息。否则，乙方有权拒绝甲方开仓和出金指令，并有权进一步限制甲方的交易权限。甲方在开户时提供的其他信息发生变更时，也应及时向乙方更新。如因甲方未能及时提供更新信息而导致的后果、风险和损失由甲方承担。

**第六条** 乙方根据反洗钱法律法规履行投资者身份识别、可疑交易报告及其他反洗钱义务，甲方应当积极予以配合。

**第七条** 乙方应当在营业场所置备期权交易法律、法规、规章、交易所及中国结算业务规则、乙方管理制度等相关文件，提供网上查询等方式供甲方查询乙方从业人员名册及从业人员资格证明等资料。甲方可以向乙方询问上述材料及其内容的含义，乙方应当予以必要解释。

### 第三章 开户

**第八条** 甲方向乙方申请开立衍生品合约账户（以下简称合约账户）及衍生品保证金账户（以下简称保证金账户），须到乙方柜台或采用交易所认可的其它方式办理。

甲方向乙方申请开立合约账户的，其合约账户对应的证券账户须同样指定在乙方并委托乙方托管、结算。

**第九条** 甲方为机构投资者的，应当依法指定合法的代理人（包括开户代理人、指令下达人、资金调拨人、结算单确认人等）。

**第十条** 甲方指定的代理人在甲方授权范围内所做出的任何行为均代表甲方行为，甲方应承担由此产生的全部责任。

甲方如变更代理人，应当书面通知乙方并经乙方确认。甲方的法定代表人或者负责人应当在授权委托书以及变更通知上签字，并加盖甲方公章。

**第十一条** 甲方为个人投资者的，申请开户前应当如实填写《股票期权投资者适当性综合评估表》，通过乙方根据要求进行的投资者适当性综合评估。

甲方为个人投资者的，申请开设合约账户及保证金账户时须出示本人身份证件（包含身份证、护照或其他证明本人身份的法定身份证件，以下统称“有效身份证件”）及其复印件，并按乙方要求如实填写开户申请材料。

**第十二条** 甲方为机构投资者的，开设合约账户和保证金账户时须出示下列证件，并按照乙方要求如实填写开户申请材料：

1、法人身份证明文件副本及其复印件，或加盖发证机关确认章的复印件，法定代表人证明书、法定代表人身份证明原件及复印件；

2、加盖机构公章、法定代表人签字的授权委托书以及代理人身份证明原件及复印件；

3、监管机构要求的其他证明材料。

**第十三条** 甲方提供的开户材料完整，并符合相关条件和要求的，乙方为甲方向中国结算申请配发实名合约账户号码，并为甲方开立保证金账户。

**第十四条** 甲方在乙方开立的合约账户，仅用于期权合约的

交易，不可用于证券现券交易或者存放证券现券。甲方合约账户未完成销户的，不得办理对应证券账户的转指定或者销户业务。

**第十五条** 甲方在乙方开立的保证金账户，存放甲方用于期权交易、结算与行权交割等的资金。乙方通过该账户对甲方的期权交易进行前端控制、清算交收和计付利息等。

**第十六条** 甲方开设合约账户与保证金账户时，应同时自行设置交易密码和资金密码（以下统称密码）。甲方在正常的交易时间内可以随时修改密码。甲方必须牢记该密码。

甲方应当妥善管理自己的密码，并自定义和全权管理本人的密码。由于甲方管理不善造成密码泄密所带来的损失，乙方不承担责任。

**第十七条** 乙方根据中国证监会、交易所等的有关规定，对甲方参与期权交易进行投资者适当性管理。甲方应当根据乙方要求，如实提供用于投资者适当性评估及开户的相关信息和材料，并对其真实性、完整性、合法性负责。

**第十八条** 乙方根据交易所的有关规定及本合同约定，对甲方参与期权交易的交易权限进行分级管理。

甲方为个人投资者的，乙方根据其适当性管理综合评估结果、股票期权知识测试分数以及具备的期权模拟交易经历，核定甲方的交易权限。

甲方申请调高交易权限级别的，乙方根据交易所的规定及本合同约定对其进行综合评估。甲方申请符合条件的，乙方对其交

易权限级别进行调整。

**第十九条** 甲方提供的用于投资者适当性评估的相关信息和材料发生重大变化的，应当及时告知乙方。乙方有根据认为甲方不再符合其交易权限对应的资格条件的，可以调低甲方的交易权限级别，乙方调低甲方交易权限级别的，应当至少提前三个交易日告知甲方调整事宜。

**第二十条** 乙方核定、调整甲方交易权限级别的，由乙方在其柜台交易系统中设定或者调整甲方交易权限级别，并以书面、短信、电子或客户端等形式告知甲方。

甲方应当按照乙方核定或者调整后的交易权限进行期权交易委托。

**第二十一条** 甲方合约账户内持有持仓及存在未了结债权债务的，乙方有权拒绝为甲方办理合约账户的销户，由此产生的一切法律责任和后果由甲方自行承担。

#### **第四章 交易委托**

**第二十二条** 乙方接受甲方委托，以乙方名义按照甲方交易指令为甲方进行期权交易，交易结果由甲方承担。

**第二十三条** 甲方可以通过互联网、期权交易客户端或书面等方式向乙方提交期权交易委托指令（以下简称交易指令）。甲方提交的交易指令类型应当符合交易所及乙方的相关规定。

**第二十四条** 甲方使用可以通过计算机程序实现自动下单或

者快速下单等功能的交易软件的，应当在使用相关软件的八个交易日前告知乙方，如甲方未及时履行告知义务的，由此产生的一切法律责任由甲方承担。

**第二十五条** 甲方下达交易指令，应当根据乙方确定的格式要求，确认以下内容：

- （一）保证金账号；
- （二）合约账户号码；
- （三）期权合约编码；
- （四）买卖类型；
- （五）委托数量；
- （六）委托类型与价格；
- （七）交易所及乙方要求的其他内容。

前款第（四）项所称买卖类型，包括买入开仓、买入平仓、卖出开仓、卖出平仓、备兑开仓、备兑平仓等。

对于上海市场期权交易，前款第（六）项所称委托类型，包括普通限价委托、市价剩余转限价委托、市价剩余撤销委托、全额即时限价委托、全额即时市价委托等。

对于深圳市场期权交易，前款第（六）项所称委托类型，包括普通限价委托、全额成交或撤销限价委托、对手方最优价格市价委托、本方最优价格市价委托、最优五档即时成交剩余撤销市价委托、即时成交剩余撤销市价委托、全额成交或撤销市价委托等。

**第二十六条** 甲方下达的交易指令，应当符合乙方以及交易所规定的要求。乙方交易系统或交易所交易系统拒绝受理的委托，以及虽被接受但根据交易所业务规则被认为无效的委托，均视为无效委托。

**第二十七条** 甲方进行网上交易的，乙方交易服务器内的委托记录将作为甲乙双方核查交易指令合法、有效的证明。甲方同意，乙方交易服务器内的交易记录与书面指令具有同等法律效力。

**第二十八条** 由于网上交易系统受各种因素的影响存在中断的可能性，为保证甲方交易的正常进行，乙方为甲方提供备用下单通道，当甲方不能正常进行网上交易时，可改作书面方式下达交易指令。

**第二十九条** 甲方以书面方式进行柜台委托时，必须提供甲方本人或其授权代理人身份证，并填写委托单，否则乙方有权拒绝受理甲方的委托，由此造成的后果由甲方承担。委托单的填写应完整、准确、清晰，并由甲方或者甲方指令下达人签字或盖章。

**第三十条** 甲方在使用非柜台委托方式进行期权交易时，必须严格按照乙方期权交易委托系统的提示进行操作，因甲方操作失误造成的损失由甲方自行承担。

**第三十一条** 乙方有权审核甲方的交易指令，包括但不限于资金是否充足、合约标的是否充足、合约持仓是否充足、开仓数量是否超过持仓限额、指令内容是否明确、是否违反有关法律、法规、规章、交易所及中国结算业务规则等，以确定指令的有效性。

当确定甲方的指令为无效指令时，乙方有权拒绝执行甲方的指令。

甲方交易指令出现超越其交易权限、持仓限额或者保证金不足等情形的，乙方有权拒绝执行甲方的指令。

**第三十二条** 甲方在下达交易指令后，可以在指令全部成交之前向乙方要求撤回指令。但如果该指令已经在交易所全部或部分成交，或者按照交易所业务规则不能撤回的，甲方应当承担交易结果。

由于市场原因或者其他非乙方原因导致甲方交易指令全部或者部分无法成交的，乙方不承担责任。乙方错误执行甲方交易指令，除甲方认可的以外，交易结果由乙方承担。

**第三十三条** 甲方有权查询自己的原始交易凭证、了解自己的账户情况，乙方应当给予积极配合。

**第三十四条** 乙方应当在其营业场所或者网站向甲方提供国内期权市场行情、信息及与交易相关的服务。

乙方可以以举办讲座、发放资料及其他方式向甲方提供期权交易知识和交易技术的培训服务。

**第三十五条** 乙方提供的任何关于期权市场的行情信息、资讯、分析和培训，仅供甲方参考，不构成对甲方下达指令的指示、诱导或者暗示。

甲方应当对自己的交易行为负责，不能以根据乙方的分析或者信息入市为理由，要求乙方对其交易亏损承担责任。

**第三十六条** 甲方应当及时了解期权交易相关的法律、法规、规章和交易所、中国结算的业务规则，并可要求乙方对上述内容进行说明，乙方应予以解释，但甲方不得要求乙方为其作出期权投资判断或决策。

## 第五章 结算

**第三十七条** 甲方同意，对于甲方的期权合约交易或者行权，乙方以自己的名义或委托结算参与人以其名义与中国结算完成集中结算，并由乙方办理乙方与甲方之间的期权结算，甲方不与中国结算发生结算关系。

甲乙双方发生的纠纷，不影响中国结算依照业务规则正在进行或已经进行的结算业务处理及违约处理。

**第三十八条** 甲方知晓并认可，甲方合约账户内的持仓，为乙方接受甲方委托以乙方的名义为甲方进行交易所形成的持仓。

甲方对其合约账户内的期权合约行权的，通过甲方合约账户对应的证券账户进行合约标的的行权交割。

**第三十九条** 甲方在进行期权交易前，应当向乙方交纳足额权利金、保证金；乙方在非行权交收日的集中交收前，应当向甲方足额收取权利金、保证金及相关费用；乙方在行权结算的集中交割、交收前，应当向甲方足额收取其应付的合约标的和资金。

除交易所、中国结算业务规则另有规定或者本合同另有约定外，乙方应当向正常履行资金交收和合约标的交割义务的甲方交

付其应收的合约标的和资金。

**第四十条** 甲方同意，在清算交收过程中，由乙方或其委托结算的结算参与人委托中国结算办理甲方与乙方之间的合约标的及相关证券划转。

乙方应保证其向中国结算发送的合约标的及相关证券划付指令真实、准确和完整，并对甲方承担因其委托错误而产生的法律责任。

**第四十一条** 发生下列情形的，甲方有权向乙方主张权利，乙方应承担相应责任并负责赔偿直接损失：

（一）因乙方过错，导致甲方被限制开仓或持仓合约被强行平仓的；

（二）因乙方过错，导致甲方应收合约标的被暂不交付或处置的；

（三）乙方对甲方出现交收违约而导致甲方未能取得行权应获得的合约标的或资金的；

（四）乙方发送的有关甲方的合约标的划付指令有误的；

（五）其他因乙方未遵守相关业务规则导致甲方利益受到损害的。

**第四十二条** 甲方知晓并同意，期权结算业务中发生异常交易情形的，按照交易所、中国结算的相关业务规则处理；期权结算业务中发生业务规则规定的现金结算情形导致甲方被实施现金结算的，按照相关业务规则规定处理。

**第四十三条** 乙方对甲方的期权交易实行当日无负债结算。甲方在交易日有交易、持仓或者出入金的，可通过乙方提供的交易终端或通过中国证券投资者保护基金有限责任公司（以下简称中国投保基金）网站（www.sipf.com.cn）查询当日交易结算和资金变动情况，了解其账户权益状况和成交结果等信息。

**第四十四条** 甲方有义务及时关注自己的交易结果、持仓情况、保证金和权益变化，并妥善处理持仓，如果甲方因某种原因无法查询当日交易结算情况的，应于下一个交易日开市前 30 分钟前向乙方提出，乙方应查询原因并通知甲方。否则，视同甲方已获取当日交易结算结果。

**第四十五条** 甲方在交易日开市前未对前日交易结算结果提出异议的，视为甲方对交易结算结果的确认。异议应由甲方本人或其授权的结算单确认人以书面方式（传真或当面提交）向乙方提出，乙方应当及时处理所收到的书面异议。

**第四十六条** 乙方或者甲方要求变更本合同约定的通知方式的，应当及时书面通知对方，并经对方确认后方可生效。否则，由变更造成的通知延误或者损失均由提出变更方负责。

**第四十七条** 甲方对当日交易结算结果的确认，视为甲方对该日及该日之前所有持仓和交易结算结果、资金出入的确认。

**第四十八条** 由于乙方原因导致系统交易结算结果的记载事项出现与实际交易结果和权益不符的，甲方的确认不改变甲方的实际交易结果和权益。对于不符事项，甲、乙双方可以根据原始

财务凭证及交易凭证另行确认。

**第四十九条** 甲方在本合同约定的时间内以约定方式向乙方提出书面异议的，乙方应当根据原始指令记录和交易记录及时核实。当对与交易结果有直接关联的事项发生异议时，为避免损失的可能发生或者扩大，乙方在收到甲方的异议时，可以将发生异议的持仓合约进行平仓或者重新执行甲方的交易指令。由此发生的损失由有过错一方承担。

## 第六章 行权

**第五十条** 期权合约到期前 3 个交易日内，乙方应当采取下列任一种方式提醒甲方妥善处理期权交易持仓：

- （一）期权交易客户端；
- （二）网站公告；
- （三）营业场所公告；
- （四）短信通知；
- （五）电子邮件通知。

**第五十一条** 甲方行权的，应当在规定的行权日内的行权申报时段向乙方提交委托指令，并应符合交易所和中国结算的相关规定。否则，乙方有权拒绝接受甲方的行权指令。

**第五十二条** 甲方可采取合并行权的方式申报行权。行权日（收盘后）15:00 至 15:30，甲方可向乙方提出行权指令合并申报委托，每一单位数量的行权指令合并申报包括同一标的的当日

到期认购和认沽期权权利仓各一张，认购和认沽期权的合约单位必须相同，认沽期权行权价需高于认购期权。

甲方可多次进行行权指令合并申报，累计申报的行权数量不应超过其持有的当日到期的权利仓净头寸（即相应衍生品合约账户组合策略到期解除后，权利仓和义务仓对冲后的持仓）。若某次申报数量超过当前可行权净头寸，则该笔申报全部无效。可行权净头寸为甲方衍生品合约账户组合策略到期解除后，权利仓和义务仓对冲后的持仓。行权指令合并申报可以撤销，撤销申报时间为行权日 15:00 至 15:30。

乙方对非行权指令合并申报和行权指令合并申报申请，按照时间先后进行前端控制，认购和认沽期权累计行权数量（扣减行权撤单后）不得超过甲方持有的相应合约权利仓净头寸。

因甲方合并行权操作不当或行权资金不足导致行权失败的，乙方不承担任何责任。

**第五十三条** 期权交割采取给付合约标的的方式进行，交易所或中国结算另有规定的除外。

**第五十四条** 甲方对认购期权行权的，应当在提交行权指令时在保证金账户存放足额的行权资金。甲方对认沽期权行权的，应当在提交行权指令时在证券账户中存放足额的合约标的。甲方未按时提交或存放足额的资金或合约标的的，乙方有权拒绝接受其行权指令。

**第五十五条** 甲方被指派为认购期权被行权方的，应当在行权

交收前在证券账户内存放足额的合约标的；甲方被指派为认沽期权被行权方的，应当在行权交收前在保证金账户存放足额的被行权资金。

**第五十六条** 根据交易所或中国结算的规定，行权交割采取现金结算方式的，甲方若为资金应付方，应当在行权交收前向乙方提交足额的资金。

**第五十七条** 甲方出现行权应付合约标的交割不足的，乙方按照交易所、中国结算业务规则的规定，以交易所或者中国结算公布的行权现金结算价格，对甲方相应期权合约进行现金结算行权交割。但乙方根据交易所、中国结算相关业务规则以及本合同的规定，利用自有证券履行行权交割义务的除外。

**第五十八条** 除以下几种情形外，甲方出现行权应付合约标的交割不足的，构成行权合约标的交割违约：

（一）期权合约行权日遇合约标的全天停牌、临时停牌直至收盘，甲方对其持有的实值认沽期权提交行权申报，中国结算对其因合约标的不足未通过有效性检查的行权申报，按照交易所公布的行权现金结算价格，以现金结算方式进行行权交割。

（二）期权合约交收日遇合约标的全天停牌、临时停牌直至收盘，对于甲方行权交割中应交付的合约标的不足部分，按照交易所公布的行权现金结算价格，以现金结算方式进行行权交割。

（三）期权交易出现异常情形，根据交易所向市场发布的公告，对相应期权合约按照交易所公布的行权现金结算价格，以现

金结算方式进行行权交割。

**第五十九条** 甲方构成行权合约标的交割违约的，乙方根据中国结算规则，对甲方未交付部分按照行权交收日合约标的收盘价的 110%进行现金结算。

**第六十条** 甲方在行权交割中出现应交付的合约标的不足，其合约账户持有未到期备兑开仓合约的，相应备兑证券将被用于当日的行权交割。由此造成的备兑证券不足部分，对于上海市场期权账户备兑证券不足的情形，甲方应按照本合同第九十一条的规定及时补足备兑备用证券或者自行平仓，否则乙方将对其实施强行平仓；对于深圳期权账户备兑不足的情形，将对备兑不足的备兑持仓转成普通持仓，甲方应按照本合同第八十八条或八十九条的规定及时补足保证金或者自行平仓，否则乙方将对其实施强行平仓。

**第六十一条** 甲方保证金账户金额不能满足行权资金交收需求的，构成资金交收违约。乙方可用自有资金进行垫付以履行向中国结算的交收义务，并按以下程序和方式对甲方进行违约处置：

（一）乙方自甲方实际构成资金交收违约时起，按天向甲方收取资金不足部分 0.1%的违约金，并按保证金账户资金利率逐日向甲方收取所垫付资金的利息。

（二）乙方有权向甲方暂不交付不低于交收违约金额的应收合约标的。暂不交付甲方的应收合约标的由乙方委托中国结算划

付至乙方证券处置账户，甲方在行权交收日次日开市前未向乙方补足资金本息和违约金的，乙方有权将证券处置账户内相应证券卖出，用于补足甲方欠付的资金本息和支付相关费用（含违约金）。对于剩余的证券或资金，归还甲方；仍有不足的，甲方同意乙方对甲方在乙方处开立的普通账户和信用账户内的资产采取限制资产转出、限制交易、卖出甲方普通账户和信用账户内的证券、扣划资金或证券等措施，所得资金用于弥补甲方的资金交收违约及因此产生的利息与违约金；如仍有不足的，乙方有权采取法律措施向甲方继续进行追索，直至清偿所有债务。上述情形下产生的法律责任，由甲方承担。

**第六十二条** 乙方进行相关证券处置时，有权自行选择处置证券的品种、数量、价格、时间、顺序等，甲方同意不以处置的时机未能选择最佳价格或者数量为由向乙方主张任何权益。

**第六十三条** 甲方行权资金交收违约并造成乙方对中国结算违约的，乙方有权将甲方相当于交收违约金额的应收合约标的指定为暂不交付合约标的并由中国结算按其业务规则进行处置。相关法律责任由甲方承担。

**第六十四条** 行权交收通知、行权资金的交收、合约标的交割及行权交收违约的处理办法，依照交易所、中国结算的交收规则以及本合同的约定执行。

**第六十五条** 乙方为甲方提供协议行权服务，甲方可通过乙方期权交易系统签署协议行权服务，甲方应当在行权日 15:00 前

签署自动行权协议。协议行权触发条件为行权日收市时为实值的、甲方已签署协议行权并且未主动发出行权委托的合约，乙方将于行权日 15:00 后为满足协议行权触发条件的所有合约自动提交行权委托。

乙方根据本合同约定为甲方发出行权申报的，甲方应当承担相应的行权结果，并履行合约标的交割、行权资金交收义务。

甲方撤回协议行权申报委托权限的，应当以书面方式告知乙方或者在乙方提供的期权交易客户端中进行相应撤销操作，在撤销操作生效前已经申报的委托仍然有效。

因甲方在协议行权触发后主动撤销行权申报、甲方行权资金或标的证券不足、甲方手工重复委托或不可预见的系统故障等其他原因引致的协议行权执行失败，乙方不承担任何责任。

## 第七章 风险控制

**第六十六条** 甲方可以以现金或者本合同规定的证券形式向乙方交纳保证金，用于期权交易的结算和期权合约的履行。

**第六十七条** 甲方以现金形式交纳的保证金（以下简称“资金保证金”）额度，与甲方以证券形式交纳的保证金（以下简称“证券保证金”）按照乙方规定的折算率折算后的额度合并计算。

**第六十八条** 乙方根据中国结算及交易所的相关规定，自主确定和调整甲方证券保证金的以下相关事项：

- (1) 可提交为保证金的证券种类、范围及折算率；

- (2) 可提交为保证金的单一证券的最高限额；
- (3) 证券保证金的转入、转出方式及要求；
- (4) 乙方对证券保证金的处分权利及处置方式；
- (5) 证券保证金的权益处理。

上述事项乙方将通过公告或本合同约定的其它通知方式告知甲方后即生效，甲方承诺遵守乙方上述事项的规定，对此不持任何异议。

**第六十九条** 乙方根据交易所和中国结算的规定制定甲方的维持保证金和开仓保证金收取标准，并以公告或者甲方认可的其他方式告知甲方。乙方确定的保证金收取标准不低于交易所和中国结算向乙方收取的保证金标准。

**第七十条** 乙方有权根据交易所和中国结算的规定、市场情况，或者乙方认为有必要时自行调整保证金比例。乙方调整保证金比例时，以乙方发出的调整保证金公告或者通知为准。保证金调整情形包括但不限于临近行权日调整、交易所根据市场情况进行调整、乙方根据客户风险控制情况进行调整等。

**第七十一条** 乙方认为甲方持有的未平仓合约风险较大时，有权对甲方单独提高保证金比例或者拒绝甲方开仓，具体风险判断标准由乙方全权决定。在此种情形下，提高保证金或者拒绝甲方开仓的通知单独对甲方发出，并自发出之日起生效，对甲方具有约束力。

**第七十二条** 甲方应当根据乙方确定的维持保证金收取标准

及时、足额向乙方交纳维持保证金。

**第七十三条** 乙方按确定的开仓保证金收取标准对甲方卖出开仓申报计算对应的开仓保证金额度，并根据甲方保证金余额情况，对其卖出开仓及买入开仓申报进行前端控制。

**第七十四条** 甲方保证金余额少于卖出开仓申报对应的开仓保证金额度和交易费用的，该卖出开仓申报无效。甲方保证金余额等于或者高于卖出开仓申报对应的开仓保证金额度和交易费用的，该卖出开仓申报有效，乙方在其保证金数据中记减相应的开仓保证金额度和交易费用。

甲方进行买入开仓时，其资金保证金余额少于买入开仓对应的权利金额度和交易费用的，该买入开仓申报无效。资金保证金余额等于或者高于买入开仓对应的权利金额度和交易费用的，该买入开仓申报有效，乙方在其保证金余额中记减相应的权利金额度和交易费用。

**第七十五条** 甲方就其持仓合约构建组合策略的，乙方按照不低于交易所及中国结算规定的标准收取相应保证金，甲方自行对其构建的组合策略的有效性、可行性及合规性负责，该组合策略所产生的全部责任及风险均由甲方自行承担。

1、甲方可以在交易日按交易所规定时间申报构建组合策略，乙方根据交易所以及中国结算的规定返还多余保证金。返还金额为未构建组合时的保证金总额减去构建组合后的保证金总额。

2、甲方备兑持仓不能构建组合策略。组合策略中的成分合约

持仓计入该合约的持仓限额。合约停牌期间允许进行组合策略构建，停市期间不允许进行组合构建。构建组合策略的申报不能撤单。行权日前一交易日和行权日，当月合约不能进行垂直价差组合策略的构建。

3、甲方可以在交易日盘中（9:30-11:30、13:00-15:15）解除组合策略，将已建组合策略拆分成多个成分合约的持仓。组合策略拆分各单个成分合约保证金必须按乙方要求和标准缴纳足额，才能拆分成功。合约停牌期间允许进行组合策略解除，停市期间不允许进行组合解除。解除组合策略的申报不能撤单。

4、对甲方组合策略持仓，如涉及各成分合约均不是最后交易日或到期日，在未解除前，组合策略持仓中的合约不参与日终的头寸对冲（普通转备兑、备兑转普通除外）。

5、对于垂直价差组合策略，在合约到期日的前两个交易日日终，交易所交易系统将先对组合进行自动解除，再进行所有持仓的对冲操作。中国结算根据对冲后的持仓情况根据维持保证金收取标准收取维持保证金。

6、对于跨式和宽跨式空头组合策略，在合约到期日日终交易所交易系统将先对组合策略自动解除，再进行所有持仓的对冲操作。

7、合约临近行权，甲方存在解除组合策略资金不足或其它可能造成乙方垫付资金引起乙方流动性风险和合规风险的，乙方有权在交易所自动解除日期之前提前强制解除甲方的所有组合，解

除后甲方存在保证金不足的，且甲方未在解除日 14:30 前补足资金的，乙方有权在 14:30 后对甲方已有持仓或全部持仓进行强平以弥补甲方保证金不足差额。

8、甲方因保证金不足被强制平仓的，乙方优先选择非组合义务仓位强平。强平后保证金仍不足，乙方可以强制解除组合策略持仓，可选择按照组合头寸中组合持仓占用保证金由多到少的顺序进行强平，乙方有权利根据实际情况选取任意组合持仓进行解除并强平。

9、因临近到期，甲方组合策略到期自动解除、交易所强行解除或乙方强制解除造成的可用资金为负的情形，强制平仓仍然不足以补足资金缺口的，且甲方未在解除日当日补足资金的，乙方可选择为甲方进行垫资并每日按垫资金额 0.1%或以上标准收取罚息，甲方后续仍不补足资金缺口的，乙方将采取法律手段依法追缴。乙方有权根据甲方违约严重情况对甲方采取调降交易权限、调降限仓限额、限制交易，纳入黑名单管理等措施。

10、存在合约停牌、到期日顺延、异常情况取消交易、标的异常情况等情形的，乙方按照交易所和中国结算要求通过官网或客户端提示等方式向市场公告。

**第七十六条** 乙方在期权保证金结算银行开设客户期权保证金专用账户，统一存放并管理甲方及乙方其他客户缴纳的用于期权交易的资金。

**第七十七条** 甲方通过在开户申请表中登记的投资者期权银

行结算账户向乙方在同一保证金结算银行开设的客户保证金专用账户转账，实现资金保证金的入金；通过将保证金从乙方客户保证金专用账户转出至甲方投资者期权银行结算账户，实现资金保证金的出金。

甲方资金保证金的出入金方式应符合中国证监会、保证金安全存管监控机构以及保证金结算银行资金结算的有关规定。

**第七十八条** 乙方在中国结算开设股票期权客户证券保证金账户，统一存放并管理甲方及乙方其他客户缴纳的用于期权交易的证券保证金。

**第七十九条** 甲方知晓并同意，存放在乙方客户证券保证金账户内的证券，作为乙方向中国结算提交的证券保证金，用于乙方期权结算和保证期权合约的履行。

**第八十条** 甲方可以根据本合同的约定以及乙方作出的其他规定，将其普通证券账户内持有的证券提交为保证金。

甲方可以根据本合同的约定以及乙方作出其他的规定，向乙方提出证券保证金转出指令，申请将其提交的证券保证金转出至甲方普通证券账户。

乙方可以根据交易所及中国结算的业务规则，对甲方转出证券保证金的条件作出规定，并以公告或者通知的方式告知甲方。

**第八十一条** 甲方应当保证其保证金来源的合法性。乙方有权要求甲方对保证金来源的合法性进行说明，必要时可以要求甲方提供相关证明。

甲方对其所做的说明及提供的证明文件负保证义务，并承担相应的法律责任。

**第八十二条** 甲方可以通过中国证券投资者保护基金有限责任公司网站（www.sipf.com.cn）查询期权保证金相关信息。

**第八十三条** 甲方交存的保证金属于甲方所有，除下列可划转的情形外，乙方不得挪用甲方保证金：

- （一）依照甲方的指示支付可用资金；
- （二）为甲方交存保证金；
- （三）为甲方支付期权合约权利金；
- （四）为甲方支付期权行权交收价款或者甲方未履约情况下的违约金；
- （五）甲方应当支付的佣金、费用或者代扣税款；
- （六）根据中国结算业务规则以自有资金垫付甲方款项后，收回垫付的款项本息及违约金；
- （七）根据中国结算业务规则以自有证券通过甲方衍生品合约账户履行乙方行权结算义务后，收回相应的行权资金；
- （八）转回利息收入；
- （九）有关法律、法规或中国证监会、交易所、中国结算规定的其他情形。

**第八十四条** 乙方应当对甲方期权保证金账户的有关信息保密，但国家法律法规和中国证监会有特别规定的除外。

为保障甲方保证金的安全，甲方同意乙方按照中国证监会的

规定或要求，向期权保证金安全存管机构报送甲方与保证金安全存管相关的信息。

**第八十五条** 甲方出现下列情形之一的，乙方有权对甲方实施强行平仓：

（一）保证金低于乙方规定标准且未能在乙方规定时间内补足或者自行平仓；

（二）备兑证券数量不足且未能在乙方规定时间内补足备兑备用证券或者自行平仓；

（三）持仓数量超过乙方规定的持仓限额，但因交易所采取风险控制措施等原因降低市场主体持仓限额、乙方根据经纪合同约定对客户的持仓限额作出调整或者客户申请的持仓额度到期导致其持仓超限的除外；

（四）本合同约定或者乙方认定的其它情形。

**第八十六条** 乙方在实施强行平仓时享有全权决定权，包括但不限于有权自主决定平仓的时间、顺序、合约的种类、价格和数量，乙方有权自主选择全部或部分平仓；甲方同意不以强行平仓的时机未能选择最佳价位和数量为由向乙方主张权益。乙方在采取强行平仓措施后，应在事后及时将有关情况告知甲方。

**第八十七条** 乙方在采取强行平仓措施期间或之后，如甲方仍欠付乙方的资金本息和违约金的，甲方同意乙方对甲方在乙方处开立的普通账户和信用账户内的资产自行采取限制资产转出、限制交易、卖出甲方普通账户内的证券、扣划资金或证券等措施，

所得资金用于弥补甲方的资金交收违约及因此产生的利息与违约金；如仍有不足的，乙方有权采取法律措施向甲方继续进行追索，直至清偿所有债务。

**第八十八条** 乙方在盘中对甲方实时风险值进行监控。当甲方实时风险值 1 高于 90%时，乙方及时向甲方发出风险警示通知(如同一交易日内乙方已向甲方发送过风险警示通知，可不再通知)，并有权限制甲方新开仓。甲方应当追加保证金，直至实时风险值 1 不高于 90%或乙方根据实际情况酌情决定的其他标准。

当甲方实时风险值 1 高于 100%时，乙方及时向甲方发出追加保证金通知(如同一交易日内乙方已向甲方发送过追加保证金通知，可不再通知)，同时限制甲方新开仓。甲方应当在当日收市前追加保证金或者自行平仓，直至实时风险值 1 不高于 90%或乙方根据实际情况酌情决定的其他标准。

当甲方实时风险值 2 高于 100%时，乙方及时向甲方发出强行平仓通知。甲方应当在当日下午 14:30 或乙方通知要求的更早时间前追加保证金或者自行平仓。甲方未在乙方要求的时间内追加保证金或者自行平仓的，乙方有权对甲方进行强行平仓，直至甲方实时风险值 1 不高于 90%或乙方根据实际情况酌情决定的其他标准。当出现极端异常情况时，乙方有权在不通知甲方的情况下，对甲方的部分或者全部未平仓合约强行平仓，直至甲方实时风险值 1 不高于 90%或乙方根据实际情况酌情决定的其他标准。

**第八十九条** 乙方日终对甲方维持保证金比例进行监控。当甲方维持保证金比例 1 高于 100%时，乙方日终向甲方发出强行平仓通知，甲方应当在下一交易日 10:00 或乙方通知要求的更早前追加保证金或者自行平仓。甲方未在乙方要求的时间内追加保证金或者自行平仓的，乙方有权对甲方进行强行平仓，直至甲方维持保证金比例 1 或实时风险值 1 不高于 90%或乙方根据实际情况酌情决定的其他标准。

当甲方维持保证金比例 2 高于 100%时，乙方日终向甲方发出强行平仓通知。当日日终，乙方以自有资金补足甲方保证金不足部分。甲方应当在下一交易日开盘前及时追加保证金，甲方未及时追加保证金的，乙方有权在开盘后对甲方的部分或全部未平仓合约强行平仓，直至甲方维持保证金比例 1 或实时风险值 1 不高于 90%或乙方根据实际情况酌情决定的其他标准。乙方按天向甲方收取资金不足部分 0.1%的违约金，并按保证金账户资金利率逐日向甲方收取所垫付资金的利息。

**第九十条** 乙方按照以下标准对甲方的可取资金进行计算：

可取资金 = 上一交易日日终结算后资金保证金总额 + 当日入金 - 当日出金 - 手续费 + 当日权利金收入 - 当日权利金支出 - max(占用未对冲实时价格保证金, 占用未对冲开仓保证金) × 115% - max(当日权利金收入 - 当日权利金支出, 0) - 行权待交收冻结资金 - 其他相关冻结资金。

按上述公式计算的可取资金不大于 0 时，甲方不可提取现

金；按上述公式计算的可取资金大于 0 时，甲方可提取现金。

**第九十一条** 当甲方备兑开仓持仓的备兑证券不足时，乙方可以冻结甲方证券账户中未锁定的合约标的；如甲方证券账户中无合约标的的，乙方立即向甲方发出平仓通知，甲方应当在下一交易日 10:00 或乙方通知要求的更早时间前补足备兑证券或对不足部分数量自行平仓。甲方未在乙方要求的时间内追加备兑证券或者自行平仓的，乙方有权就不足部分对甲方的部分或全部未平仓合约强行平仓，直至甲方备兑证券足额或乙方根据实际情况酌情决定的其他标准。

甲方备兑开仓持仓在存续期内出现备兑证券不足的，乙方可以按备兑不足期权合约数量锁定甲方保证金账户内相应保证金。

**第九十二条** 乙方根据交易所的持仓限额规定，对甲方未平仓合约数量进行持仓限额管理，持仓限额包括但不限于：

- 1、对单个合约品种的权利仓持仓限额；
- 2、对单个合约品种的总持仓限额；
- 3、对单个合约品种单日买入开仓限额。

上述持仓限额标准乙方将以公告或者本合同约定的其它通知方式告知甲方，甲方承诺接受该持仓限额的管理，不持任何异议。乙方据此对甲方的开仓及持仓情况进行前端控制。乙方可以根据交易所公布的持仓限额标准以及甲方实际情况，不时调整甲方的持仓限额标准，并以公告或者本合同约定的其它通知方式告知甲方。

**第九十三条** 甲方为个人投资者的，乙方核定其持有的权利仓对应的总成交金额限额（以下简称买入金额限额）为下述金额中较高者：

1、甲方证券账户持有的证券市值与资金账户可用余额（不含融入的证券和资金）的 10%；

2、甲方证券账户过去 6 个月日均持有沪深证券市值的 20%。

乙方据此对甲方买入开仓及持仓情况进行前端控制。乙方可以根据交易所公布的标准以及甲方实际情况，调整甲方的买入金额限额标准，并以公告或者本合同约定的其它通知方式告知甲方。

**第九十四条** 当甲方持有的未平仓合约数量超过持仓限额规定时，乙方及时向甲方发出平仓通知，甲方应当在下一交易日 10:00 或乙方通知要求的更早时间前自行平仓。甲方未在乙方要求的时间内自行平仓的，乙方有权对甲方的部分或全部未平仓合约强行平仓，直至甲方满足持仓限额要求或乙方根据实际情况酌情决定的其他标准。

因交易所采取风险控制措施等原因统一降低持仓限额、乙方根据经纪合同约定对甲方的持仓限额作出调整或者甲方申请的持仓额度到期，导致甲方未平仓合约数量超过持仓限额规定的，乙方不对甲方超出持仓限额的持仓实施强行平仓，但甲方在自行平仓直至满足降低后的持仓限额前不得再进行相应买入或者卖出开仓。

**第九十五条** 甲方知晓并同意，交易所、中国结算有权根据相关业务规则的规定，对甲方持有的未平仓合约实施强行平仓。甲方不对交易所或中国结算根据业务规则规定执行的强行平仓主张权益。

**第九十六条** 乙方、中国结算根据法律、法规、规章、业务规则或者本合同约定进行强行平仓时，甲方是直接责任人的，应承担强行平仓的手续费及由此产生的结果，并享有强行平仓产生的盈利，由于市场原因导致乙方无法采取强行平仓措施产生的损失由甲方承担；甲方不是直接责任人的，由乙方先行向甲方承担相关损失，再向直接责任人追索，甲方应当提供必要协助。

**第九十七条** 甲方被交易所要求报告持仓情况的，应当按照规定的内容及时间要求，向乙方报告其持仓、资金以及交易用途等情况，并由乙方提交给交易所。

甲方应当配合乙方履行报告义务，向乙方如实提供前款所列资料，保证所提供资料真实、准确、完整。若甲方不提供或乙方有合理理由怀疑其提供的信息虚假或不准确，乙方有权要求其及时补正。若甲方不按要求补正，由此产生的后果由甲方承担。

**第九十八条** 有下列情形之一的，乙方有权对甲方采取提高保证金、限制开仓、降低交易权限、调低买入额度、限制甲方期权合约账户全部或部分功能、拒绝甲方委托或者终止经纪关系等措施：

（一）甲方提供的资料、证件失效或严重失实的；

(二) 甲方风险测评有效期过期或最近测评的风险承受能力变化不再符合证监会、中证协、交易所或乙方规定的期权投资者适当性管理要求的；

(三) 甲方出现频繁或严重的资金或证券交收违约损害乙方合法权益、影响乙方正常经营秩序的；

(四) 甲方有其它严重损害乙方合法权益、影响其正常经营秩序的行为；

(五) 乙方认定甲方资金来源不合法，或甲方违反反洗钱监管规定的；

(六) 甲方发生符合交易所异常交易认定标准的异常交易行为或其他违规交易行为的；

(七) 乙方应监管部门要求或者甲方违反法律、法规、规章、政策及交易所规则规定的其他情形。

## 第八章 通知与确认

**第九十九条** 甲方提供签署页中联络方式供乙方通知使用。甲方提供的联络方式如有变动，可通过乙方移动终端、官方网站或前往营业场所等渠道办理资料变更手续，否则乙方仍然以变动前记录在乙方系统内的联络方式为有效联络方式，因联络方式失效造成的损失均由甲方负责。

**第一百条** 乙方可采用以下任意一种通知方式向甲方发送追加保证金通知、平仓通知、单独调整保证金通知等文件，任意

一种通知方式送达即视为乙方已完成通知义务：

- （一）电子邮件；
- （二）短信；
- （三）电话。

如以电子邮件方式发出通知的，以电子邮件发出视为已通知送达；以电话方式通知的，以通话当时视为已通知送达，电话无法接通或无人接听的，以拨出电话时间视为已通知送达；以短信方式通知的，以短信发出时视为已通知送达。

**第一百〇一条** 交易所、中国结算根据其业务规则的规定调整期权交易的保证金标准、持仓限额以及其他相关标准，或乙方根据本合同约定调整期权交易的保证金标准、持仓限额以及本合同约定的其他相关标准，以下任意一种通知方式送达即视为乙方已完成通知义务：

- （一）网站公告；
- （二）营业场所公告；
- （三）电子邮件通知。

如以网站公告方式发出通知的，以公告发布视为已通知送达；以营业场所公告方式通知的，以公告张贴视为已通知送达；以电子邮件方式通知的，以邮件发出时视为已通知送达。

## 第九章 合同生效、变更与终止

**第一百〇二条** 本合同经双方签字（甲方为机构投资者的须

加盖公章)之日起生效。

**第一百〇三条** 本合同履行过程中，如果相关法律、法规、规章、政策、交易所或者中国结算的业务规则发生变化，乙方有权直接变更本合同与此相关部分的条款，变更或补充条款优先适用。

根据上述情况的变化，乙方对本合同有关条款进行的变更或补充，以本合同约定的通知方式及在乙方营业场所、网站、期权交易客户端公告等方式向甲方发出，变更或补充合同生效日以公告为准。

**第一百〇四条** 除前条所述情况外，乙方根据业务运营的实际情况，有权变更本合同与此相关部分的条款，并以本合同约定的通知方式及在乙方营业场所、网站、期权交易客户端公告等方式向甲方发出，变更或补充合同生效日以公告为准。甲方不同意变更的，应在合同变更生效日前提前了结全部交易并办理销户手续，否则视为甲方已经同意合同变更。

**第一百〇五条** 本合同履行过程中的未列明事宜，按国家有关法律、法规、规章、政策及交易所、中国结算的规则、乙方相关业务规则以及期权交易惯例处理。

**第一百〇六条** 甲乙双方均有权经协商一致后解除本合同，合同的解除对已发生的交易无溯及力。

**第一百〇七条** 乙方向甲方提出解除合同的，应当提前3天以书面形式通知甲方。甲方未在此期间内自行清理账户的，乙方

有权拒绝甲方的新单交易指令及资金调拨指令，甲方应对其账户清算的费用、清算后的债务余额以及由此造成的损失负全部责任。

**第一百〇八条** 甲方可以通过注销账户的方式终止本合同。但在下列情况下，甲方不得注销账户或者终止合同：

（一）甲方账户上持有未平仓合约或存在交收遗留问题尚未解决；

（二）甲方与乙方有未清偿的债权、债务关系；

（三）甲方与乙方有交易纠纷尚未解决的。

**第一百〇九条** 乙方因故不能从事期权业务时，应当采取必要措施妥善处理甲方的持仓和保证金。经甲方同意，乙方应将甲方持仓和保证金转移至其他期权经营机构，由此产生的合理费用由乙方承担。

**第一百一十条** 甲方、乙方终止合同的，甲方应当办理书面销户手续，签署销户表单。

## 第十章 免责条款与争议解决

**第一百一十一条** 由于地震、火灾、战争等不可抗力因素导致的交易中断、延误等，乙方不承担责任，但应当在条件允许的范围内采取一切必要的补救措施以减少因不可抗力造成的损失。

**第一百一十二条** 由于国家有关法律、法规、规章、政策或者交易所、中国结算修改业务规则或者采取包括但不限于调整保

证金、调整涨跌停价格、调整持仓限额、限制交易、取消交易、强行平仓等风险控制措施等导致甲方承担的风险或者损失，交易所、中国结算及乙方不承担责任。

**第一百一十三条** 由于通讯系统繁忙、中断，计算机交易系统故障，网络及信息系统故障，电力中断等原因导致指令传达、执行出现延迟、中断或数据错误，乙方没有过错的，乙方不承担责任。

**第一百一十四条** 由于不可抗力、意外事件、交易所或者中国结算发生技术故障、重大差错等突发事件及其交易所、中国结算采取的相关措施，造成甲方损失的，交易所、中国结算及乙方不承担责任。

**第一百一十五条** 由于互联网上黑客攻击、非法登陆等风险的发生给甲方造成的损失，乙方不承担责任。

**第一百一十六条** 乙方交易系统与交易所、中国结算的交易和结算系统的时间可能存在不一致。甲方通过乙方交易系统提交期权交易委托时，乙方交易系统时间仅供参考，实际申报、成交等时间以交易所交易主机的时间为准。乙方对交易系统显示时间的准确性及其与交易所、中国结算的系统时间的一致性不作任何保证，亦不就此承担责任。

**第一百一十七条** 凡因本合同引起的或与本合同有关的任何争议，甲乙双方可以自行协商解决，协商不成的甲乙双方同意提交乙方所在地法院提起诉讼。

## 第十一章 其他事项

**第一百一十八条** 甲方不得利用在乙方开立的账户，以乙方工作人员的身份活动，通过网上交易或其他形式开展期权经纪业务或其他活动。若因甲方过错而使乙方遭受损失和不良影响的，甲方应当承担相应的赔偿责任。

**第一百一十九条** 甲方应当向乙方支付期权交易和交收的佣金。佣金收取标准以乙方公告为准，甲乙双方另有约定的，按照相关协议约定执行。

甲方应当支付乙方向交易所、中国结算代付的各项费用及税款。

**第一百二十条** 本合同未尽事宜，双方另行议定。

**第一百二十一条** 《股票期权风险揭示书》、《投资者须知》、《开户申请表》及其他补充合同为本合同不可分割的组成部分，与本合同具有同等法律效力。

除本合同已经预留的相应限定内容的填写条款外，本协议在印刷文本之外的手写修改均无效，对各方均无任何约束力。

**第一百二十二条** 本合同一式三份，乙方执二份，甲方执一份。