

## 国元证券股份有限公司

### 深交所质押式报价回购交易风险揭示书

尊敬的客户：

为了使您充分了解深交所质押式报价回购（以下简称“报价回购”）交易风险，根据《中华人民共和国证券法》等相关法律、法规、规章以及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则及规定，特向您提供《国元证券股份有限公司深交所质押式报价回购交易风险揭示书》（以下简称《风险揭示书》），请您认真阅读本《风险揭示书》内容，慎重决定是否参与报价回购交易。报价回购交易存在包括但不限于以下风险：

一、报价回购交易具有市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、政策风险及其他风险。

二、客户在办理报价回购交易前，应认真仔细阅读本《风险揭示书》，对自身参与的适当性、合法性进行审慎评估，并以真实身份参与，包括但不限于：客户应当根据自身的财务状况、实际需求、风险承受能力、以及内部管理制度（若为机构客户），慎重考虑是否适宜参与报价回购交易。避免因不当参与而产生损失。

三、客户在参与报价回购交易前，应了解国元证券股份有限公司（以下简称“国元证券”“公司”或“我公司”）是否已获得深交所同意并开通报价回购交易权限。

四、客户应关注报价回购交易中，国元证券既是客户的交易对手方，又根据客户委托代为办理有关交易申报、登记结算等事宜，可能存在由此带来的利益冲突风险。

五、报价回购交易中，可能出现因资金不足、系统故障等导致 T+1 日（T 为交易日）资金划付失败，需要将相应资金划付延迟至 T+2 日所带来的风险。如果 T+2 日仍无法完成资金划付，则属于违约，相应的违约方应承担违约责任。

六、报价回购交易全部质押物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，客户所享有的质权不对应具体质押物品种，客户不得单独就质押物主张行使质权。当证券公司违约时，全体质权人可以共同行使质权。质押物处置所得由客户按债权比例公平受偿。

七、客户应关注报价回购交易中可能面临的交易对手信用风险，以及由此可能造成的损失，包括但不限于因公司原因导致证券或资金划付失败，因质押券价值波动、折算率调整、司法冻结或扣划等导致质押物不能足额担保所有报价回购债务，以及我公司被暂停或终止报价回购权限、进入风险处置或破产程序等。

八、客户应关注国元证券如报价回购业务权限终止后，将首先由公司根据《国元证券股份有限公司深交所质押式报价回购交易客户协议》（以下简称《客户协议》）的约定对质押券进行处置，并由其将处置所得与担保资金之和按债权比例优先向客户公平清偿。仅当国元证券怠于、不当或无法处置时，将由国元证券依据《客户协议》的约定委托进行质押券处置的机构对质押券进行处置。

九、国元证券与客户已在《客户协议》中对质押券选择与担保价值计算依据进行约定，由此带来的损失或风险由客户自行承担。

十、报价回购交易的收益由国元证券公布，客户初始委托申报成功即视为同意并接受该收益。客户已知悉并完全理解该收益属于双方一致同意的约定收益，与其他市场收益可能存在偏差。若市场发生变化，已达成的收益不会进行相应调整，客户可能面临无法获取更高收益的风险。

十一、国元证券可能会根据报价回购实际交易情况对各交易品种设置规模上限或限制客户参与报价回购交易品种购买额度，可能会影响客户资金收益。

十二、报价回购交易发生巨额不再续做或提前购回时，国元证券有权根据《客户协议》的约定拒绝不再续做或提前购回申请，可能影响客户的资金使用安排和流动性。

十三、报价回购交易发生标准券折算率调整、质押物到期、质押物被司法冻结或扣划等情形时，可能使得质押物不能足额担保国元证券履行所有购回义务。报价回购交易因折算率调整、司法冻结等情况产生质押物不足的，国元证券可能向客户提出全部或部分未到期回购提前购回，可能会影响客户资金收益。

十四、国元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。

十五、国元证券报价回购交易可能被暂停或进入业务终止，并可能因此不能及时、足额偿付客户。

十六、客户应关注报价回购交易中可能存在的操作风险，以及由此可能造成的损失，包括但不限于由于回购双方未按规定和约定进行申报交易和结算申报，交易要素

填报错误、资金划付、通知与送达异常等操作风险，导致交易不能按期达成。

十七、客户应及时关注国元证券官网、国元点金 APP 等平台的通知公告和信息推送，及时了解深交所报价回购业务相关的信息披露。如因您不能及时查看相关的通知信息，由此产生的风险和损失由您自行承担。

十八、客户应关注报价回购交易中面临的因公司技术系统故障或差错所带来的风险，以及由此可能造成的损失。如在遵守国家相关法律、法规、规章及自律组织规则前提下，国元证券尽力为客户提供高速、快捷的交易服务，但因受制于证券市场监管要求、交易规则、技术能力等多种因素影响，或由于网络数据传输等原因，交易指令可能会出现中断、停顿、延迟、数据错误等情况。

十九、客户应关注账户号码、身份证件和交易密码等资料的安全，如客户将证券账户、身份证件、交易密码等出借或告知给他人使用，或因客户原因导致上述资料泄漏，由此带来的风险由客户承担。

二十、在报价回购交易的存续期间，国元证券将以《客户协议》约定的通知与送达方式及通讯地址，向客户发送通知。通知发出并经过约定的时间后，将视作国元证券已经履行对客户的通知义务。客户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客户自行承担。

二十一、在报价回购交易的存续期间，客户的有效信息或联系方式发生变化，但未及时变更预留在国元证券的有效联系方式，导致无法通知客户相关信息，由此产生的责任和风险由客户自行承担。

二十二、客户应关注因法律法规、相关政策和规则的变化、修改等原因，可能带来的风险。

二十三、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，可能会给客户造成经济损失。

二十四、因报价回购交易产生的任何争议、纠纷，由客户与公司双方协商或通过仲裁方式解决，与任何第三方无关，客户不得就报价回购交易向任何第三方主张权利或追究责任。

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。客户在参与报价回购交易前，应认真阅读相关业务规则及协议条款，对报价回购交易所特有的业务规则必须有所了解和掌握，并确信已做好足够的风险评估和财务安

排，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。

本风险揭示书应由客户本人签署，当客户为机构时，应由机构法定代表人或其授权代表签署并加盖公章。

本单位/本人确认已知晓并理解《风险揭示书》的全部内容，愿意承担报价回购交易的风险和损失。本单位/本人同意以电子方式签署的本《风险揭示书》，与手写签名或盖章方式签署的纸质文件具有同等法律效力。

客户（自然人签字、法人盖章）：\_\_\_\_\_

法定代表人/授权代表人签字（仅限机构客户）：\_\_\_\_\_

签署日期：        年    月    日