

## 质押式报价回购交易风险提示书

尊敬的客户：

质押式报价回购（以下简称“报价回购”）业务中存在风险。为了使您更好地了解其中的风险，根据有关证券交易法律法规、行政规章、证券交易所业务规则和证券登记结算机构业务规则，中信证券（山东）有限责任公司（下称“中信证券（山东）”）特提供本风险提示书，请您认真仔细阅读。报价回购业务中的风险包括但不限于以下内容：

一、客户在办理报价回购交易前，应对自身参与的适当性、合法合规性进行审慎评估，并以真实身份参与，客户应根据自身财务状况、实际需求、风险承受能力以及内部管理要求（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。

二、客户在参与报价回购交易前，须了解中信证券（山东）是否已获得深交所同意并开通报价回购交易权限。

三、在报价回购交易中，中信证券（山东）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。

四、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。

五、报价回购交易全部质押物设定的质权由报价回购未到期以及购回交易未完成交收的所有客户共同享有,客户所享有的质权不对应具体质押物品种和数量,客户不得单独就质押物主张行使质权。当中信证券(山东)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。

六、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:因中信证券(山东)原因导致证券或资金划付失败,因质押物价值波动、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,以及中信证券(山东)被暂停或终止报价回购权限、进入风险处置或破产程序等。

七、如果中信证券(山东)报价回购交易权限被终止,将首先由中信证券(山东)根据《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。仅当中信证券(山东)怠于、不当或无法处置时,将由中信证券(山东)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。

八、报价回购质押物除现金、债券外,还包括基金专户份额等其他质押物。客户应关注《客户协议》中对质押物选择与担保价值计算依据的约定,由此带来的损失或风险由客户自行承担。

九、报价回购交易的收益由中信证券(山东)公布,客户初始委托申报成功即视为同意并接受该收益。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、对于超出中信证券（山东）设定的额度上限的提前购回和不再续做申请，中信证券（山东）有权根据《客户协议》的约定拒绝相应的申请，可能影响客户的资金使用安排。

十一、报价回购到期资金可用数当日不能取款。客户需要在某一交易日（T日）取款的，须在该交易日之前一交易日（T-1日）15:00前办理预约取款申请，预约成功后客户可在该交易日（T日）15:00前取款，如不及时办理预约，存在T日无法取款的风险。

十二、在余额自动委托业务中，如果所有符合条件客户可自动委托金额总量超过中信证券（山东）1天期余额自动委托品种可用额度，客户余额自动委托成交金额可能小于客户可自动委托金额。

十三、客户如在交易日 15:05-15:30 间自行发出报价回购初始委托或进行其他交易或资金业务，余额自动委托、客户自行发出的报价回购初始委托、其他交易或资金业务可能因资金不足而导致失败。

十四、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，包括但不限于因中信证券（山东）原因交易不能按期达成、因通讯失效而不能及时送达相关信息，以及因客户原因没有及时了解相关通知信息等。

十五、客户应关注报价回购交易中面临的因中信证券（山东）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。

十六、客户应关注账户卡、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。

十七、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。

十八、客户应关注因火灾、地震、瘟疫、社会动乱、特殊天气等不能预见、避免或克服的不可抗力情形，可能带来的风险。

十九、因报价回购交易产生的任何争议、纠纷，由客户与中信证券（山东）双方协商或通过诉讼或仲裁等方式解决，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与财务安排，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。

本人（机构）确认已知晓并理解质押式报价回购业务、《客户协议》及《风险揭示书》的全部内容及面临的风险，愿意承担参与报价回购交易的所有风险和损失。

客户（自然人）签字：

客户（机构）盖章：

法定代表人或授权代表签署:

年 月 日

**注：《风险揭示书》应由客户本人签署，当客户为机构时，应由法定代表人或其授权代表签署并加盖公章。**