

期权业务补充协议

甲方：浙江新世纪期货有限公司

乙方：（ 客户全称 ）_____（ 资金账号 ）_____

浙江新世纪期货有限公司（ 甲方 ）与客户（ 乙方 ）经友好协商，就期权交易事项达成如下协议，作为双方签定的《期货经纪合同》的补充。

一、期权交易

（一）乙方下达的交易指令，应当符合甲方以及期货交易所规定的要求，乙方应谨慎选择使用期权市价指令。

（二）乙方可以按各交易所相关规定对没有买卖报价的期权合约进行询价。询价请求应当指明期权合约代码，不需要输入买卖方向和手数。询价时间间隔不应低于 60 秒，且不接受对已存在合理报价的合约、频繁询价或有合理报价时进行询价。

（三）甲方提供的任何关于期权市场的价格信息、资讯、预测和培训，仅供乙方参考，不构成对乙方下达指令的指示、诱导或暗示。

乙方应当对自己的交易行为负责，不能以根据甲方的预测作为入市理由，要求甲方对其交易亏损承担责任。

（四）乙方应当及时了解期权交易相关的法律、法规、规章和期货交易所的业务规则，并可要求甲方对上述内容进行述明，甲方应予以解释，但乙方不得要求甲方为其作出期权投资判断决策。

（五）乙方的保证金账户可用资金余额以甲方收取的保证金标准作为计算依据。甲方可根据交易所的规则及市场情况对保证金标准进行调整。

二、期权的结算

（一）乙方交付的期权权利金应当以货币资金支付，不得以有价证券充抵的金额支付。

若乙方为期权买方（ 卖方 ）开仓时，按照开仓成交价支付（ 收取 ）权利金；若乙方为期权买方（ 卖方 ）平仓时，按照平仓成交价收取（ 支付 ）权利金。当日结算时其权利金收支按照如下公式计算：

期权买方（ 卖方 ）开仓支付（ 收取 ）权利金 = $\sum$ 买入（ 卖出 ）开仓价 $\times$ 买入（ 卖出 ）期权合约成交量 $\times$ 期权合约相对应的期货交易单位。

期权买方（ 卖方 ）平仓收取（ 支付 ）权利金 = $\sum$ 卖出（ 买入 ）平仓价 $\times$ 卖出（ 买入 ）期权合约成交量 $\times$ 期权合约相对应的期货交易单位。

（二）乙方可申请对大连商品交易所、上海期货交易所、上海国际能源交易中心同一交易编码下同一期权合约的双向期权持仓进行对冲平仓，也可申请对同一交易编码下行权（ 履约 ）后的双向期货持仓进行对冲平仓。具体操作按照大连商品交易所、上海期货交易所、上海国际能源交易中心的规则进行。

（三）乙方应当根据期货交易所的交易规则对持有的期权合约进行了结。

乙方参加期权行权或放弃时，买卖双方持有的期权合约分别相应减少，卖方履约释放期权交易保证金。

乙方的期权行权或被动履约时，买方和卖方在结算时按照行权价格建立相应期货持仓，并按照当日期货结算价结算。

三、期权的行权与履约

（一）乙方的行权与履约应当通过甲方在期货交易所办理。

乙方作为期权买方，应当在交易所规定的行权日内的行权申报时间向甲方提出行权或放弃申请，并应符合期货交易所及公司的相关规定。否则，甲方有权拒绝接受乙方的行权指令。乙方作为期权卖方有履约义务。

（二）若乙方作为期权买方客户：

期权到期日，乙方应在交易所规定截止时间前 10 分钟之前办理行权、放弃行权、取消自动行权等业务。

期权到期日，交易所对未在规定时间内提交行权或放弃的实值期权买方自动行权。若乙方持有上述实值期权，应在交易所规定截止时间前 10 分钟之前在账户内留有足额资金，否则甲方有权代乙方向交易所提交放弃行权，由此造成的损失由乙方承担。

如果您持有权利仓在合约到期时选择不行权的，您将损失其支付的所有投资金额，包括权利金及交易费用。

（三）乙方应当知晓交易所的行权配对交易原则：

1、大连商品交易所、上海期货交易所、上海国际能源交易中心按照随机均匀抽取原则进行行权配对，配对结果以交易所发送的数据或公布的结果为准。

2、郑州商品交易所按照投机、套利、套保的顺序选择卖方持仓配对，同一持仓属性按时间最长原则选择，配对结果以交易所发送的数据或公布的结果为准。

（四）看涨期权行权与履约后，乙方若为期权买方，可按行权价格获得期货买持仓，若为卖方，可按同一行权价格获得期货卖持仓。

看跌期权行权与履约后，乙方若为期权买方，按行权价格获得期货卖持仓，若为卖方，按同一行权价格获得期货买持仓。

（五）乙方可以通过交易终端或书面委托甲方申请大连商品交易所、上海期货交易所、上海国际能源交易中心的双向期权持仓对冲、行权后期货持仓对冲和履约后期货持仓对冲。行权方式为美式的申请时间为非到期日 14:30 前和到期日 15:00 前，行权方式为欧式的申请时间为到期日 15:00 前。

（六）有下列情形之一的，甲方有权代为全部或部分行权，行权结果由乙方自行承担：

- 1、未提出放弃行权、有足额行权资金的实值期权买方客户，且行权后持仓符合交易所限仓规定的；
- 2、其他原因需代为行权的。

（七）有下列情形之一的，甲方有权撤销乙方的行权申请：

- 1、甲方使用批量行权工具预测有行权资金缺口，且未在甲方规定的时间内足额补足资金的；
- 2、乙方已提交的行权申请由于今结算价变动或标的保证金率调整等导致行权资金缺口的；
- 3、其他原因需撤销行权申请的。

（八）有下列情形之一的，甲方有权全部或部分取消自动行权或代为放弃行权，放弃行权结果由乙方自行承担：

- 1、提出放弃行权的实值期权买方；
- 2、虚值期权和平值期权买方；
- 3、行权或履约后持仓不符合交易所限仓规定的；
- 4、甲方使用批量行权工具预测有行权资金缺口，且乙方未在甲方规定的时间内足额补足资金的；
- 5、其他原因需取消自动行权或代为放弃行权的。

（九）行权与履约后，有下列情形之一的，甲方有权采取强行平仓等风控措施：

- 1、由于行权与履约后新增保证金占用或行权亏损导致账户资金不足的客户，未在甲方规定的时间内足额补足或自行减仓的；
- 2、由于行权与履约后导致持仓超仓的客户，未在甲方规定的时间内按要求减仓的；
- 3、其他应予强行平仓的。

（十）由于下列因素，甲方的行权预测可能会跟乙方实际可行权或放弃行权手数存在一定的差异，甲方根据行权预测结果代为行权或放弃行权行为结果由乙方自行承担：

- 1、组合保证金优惠；
- 2、期权行权盈亏；
- 3、期货浮动盈亏；
- 4、期权卖方被履约量；
- 5、闭市后保证金按最新结算价或保证金率调整；
- 6、其他因素。

乙方应充分了解相关规则，合理管理资金和持仓，妥善决定是否进入到期日行权，由此造成的损失由乙方承担。

（十一）乙方在到期日闭市前挂出且未成交的期权平仓单，上海期货交易所和上海国际能源交易中心由于期权持仓状态锁定，闭市后乙方交易终端将无法申请行权或放弃，乙方需提前处理未成交平仓单。乙方可以委托甲方通过会员服务系统提交单笔行权。对因乙方资金不足等原因经甲方审核不满足行权要求的，甲方有权在到期日收盘前将乙方挂出且未成交的实值期权平仓单进行撤单并申请放弃行权，由此造成的损失由乙方承担。

（十二）行权的通知、行权资金的收付、行权交收违约的处理办法，按照期货交易所的交易规则以及《期货经纪合同》及本协议的约定执行。

甲方根据本协议约定为乙方申请行权的，乙方应当承担相应的行权结果，并履行行权资金的支付义务。

四、期权的风险控制

（一）期权风险管理实行保证金制度、涨跌停板制度、限仓制度、交易限额制度、大户报告制度、强行平仓制度和风险警示制度。

（二）甲方可根据期货交易所的规定，针对期权交易不同的持仓组合，采取不同的交易保证金收取标准。

（三）乙方向甲方交纳的保证金，用于期权交易的结算和期权合约的履行。乙方应当保证其保证金来源的合法性。甲方有权要求乙方对保证金来源的合法性进行述明，必要时可以要求乙方提供相关证明。乙方对其所做的述明及提供的证明文件负保证义务，并承担相应的法律责任。

（四）甲方应当对乙方期权保证金账户的有关信息保密，但国家法律法规和监管部门有特别规定的除外。

（五）如乙方因期权行权超出期货限仓标准的，期货交易所及甲方有权按照有关规定实行强行平仓措施。如乙方保证金不足甲方规定标准的，甲方将按照期货交易所的风险管理办法及《期货经纪合同》的约定进行处理。

五、开通上海能源交易中心原油交易编码将直接开通原油期权交易权限。

六、本协议如遇与法律、法规、规则、监管部门政策以及交易所规则相冲突时，以相关法律、法规、规则及监管部门政策以及交易所规则为准。

七、本协议与期货经纪合同不一致之处，以本协议为准。本协议未规定事宜，按照期货经纪合同执行。

本协议自双方签字（乙方为机构客户的须加盖公章）之日起生效。

本协议一式三份，甲方执二份，乙方执一份。

甲方：浙江新世纪期货有限公司

授权签字

（盖章）：

乙方签字：

（机构加盖公章）

签署日期： 年 月 日

第一联 公司留存（白）

第二联 分支机构留存（黄）

客户留存（红）