

## 中山证券有限责任公司

### 股票期权业务投资者自动行权确认书

尊敬的投资者：

期权交易不同于股票交易，期权交易是具有到期价值归零风险。为了保障您的合法权益，请您仔细阅读以下内容并签字确认。

请您明确： 同意  不同意委托中山证券有限责任公司（下称“我司”）进行协议行权。

提示您在委托我司进行协议行权，按照以下约定办理：

1、由我司代为发出行权申报的期权合约范围：

行权日为当日的所有合约。

2、由我司代为发出行权申报的具体触发条件：

根据行权日合约标的证券收盘价计算期权合约实值深度，我司将对您满足相对实值深度 5% 及以上的合约发起协议行权。

相对实值深度参考计算公式如下：

认购期权相对实值深度 =  $(\text{合约标的行权日收盘价} - \text{行权价格}) / \text{合约标的收盘价} * 100\%$

认沽期权相对实值深度 =  $(\text{行权价格} - \text{合约标的行权日收盘价}) / \text{合约标的收盘价} * 100\%$

3、由我司代为发出行权申报的期权合约数量或其确定方式：

触发行权申报的所有合约发起协议行权。

4、我司代为发出行权申报后告知自动行权的具体方式及时间要求：

我司默认协议行权申报时间为 15:00-15:30，您可通过我司期权交易客户端查询。

如您同意委托我司进行协议行权，请您充分知晓以下事项：

一、请您知晓我司根据本协议约定发出行权申报的，您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。您可以通过我司提供的期权交易客户端中设置或者更改委托协议行权申报的具体事项。如您设置内容与本协议约定不一致的，以您在期权交易客户端设置内容为准。如果您自行设置协议行权策略，需要在行权日 15:00 之前进行设置。

二、请您知晓您在行权日发出的手动行权委托优先于我司自行设置的协议行权策略，您自行设置的协议行权策略优先于我司设置的默认协议行权策略。如您需要撤回协议行权申报委托权限的，应当提前（伍）个交易日以书面方式告知我司，或者在我司提供的期权交易客户端中进行相应撤销操作。

三、请您知晓我司提供的协议行权服务不包括行权指令合并申报，涉及行权指令合并申报的需要您通过交易客户端自行申报，您进行行权指令合并申报之前须确认申报时间、申报可用数量等，如您已委托行权（包括协议行权），导致无法完成行权指令合并申报的须由您先自行撤单，否则由此导致的行权指令合并申报失败的结果由您自行承担。

四、请您知晓协议行权服务是针对于您在我司开立的期权资产账户，本确认书对于您开立沪深两市衍生品合约账户或者开立单一市场衍生品合约账户均生效。

特别提示：投资者签署本确认书，表明投资者已仔细阅读并完全理解本确认书的内容。

投资者/委托代理人：

（签字或盖章）

签署日期： 年 月 日