

EXCHANGE TRADED DERIVATIVES PRODUCTS KNOWLEDGE ASSESSMENT
交易所买卖衍生产品评估

Applicant Name: 申请人姓名:	
----------------------------------	--

This form is designed to help us to establish and assess your knowledge on exchange traded derivatives products. Please complete it carefully. 本表格旨在帮助我司确定和评估阁下对交易所买卖衍生产品的认知, 请小心填写。

	Frequency of Transactions per annum 每年交易次数	Investment Experience (year) 投资经验 (年)
Warrants 认股权证 <input type="checkbox"/> Hong Kong 香港 <input type="checkbox"/> other exchanges (please specify)其它交易所 (请注明) _____ _____	<input type="checkbox"/> < 20 <input type="checkbox"/> 20 – 50 <input type="checkbox"/> > 50	<input type="checkbox"/> Nil 无 <input type="checkbox"/> < 1 <input type="checkbox"/> 1 – 5 <input type="checkbox"/> > 5
Callable Bull/Bear Contracts 牛熊证 <input type="checkbox"/> Hong Kong 香港 <input type="checkbox"/> other exchanges (please specify)其它交易所(请注明) _____ _____	<input type="checkbox"/> < 20 <input type="checkbox"/> 20 – 50 <input type="checkbox"/> > 50	<input type="checkbox"/> Nil 无 <input type="checkbox"/> < 1 <input type="checkbox"/> 1 – 5 <input type="checkbox"/> > 5
Futures and Options Contracts 期货及期权合约 <input type="checkbox"/> Hong Kong 香港 <input type="checkbox"/> other exchanges (please specify)其它交易所 (请注明) _____ _____	<input type="checkbox"/> < 20 <input type="checkbox"/> 20 – 50 <input type="checkbox"/> > 50	<input type="checkbox"/> Nil 无 <input type="checkbox"/> < 1 <input type="checkbox"/> 1 – 5 <input type="checkbox"/> > 5
Equity Linked Notes/Equity Linked Instruments 股票挂钩票据/工具 <input type="checkbox"/> Hong Kong 香港 <input type="checkbox"/> other exchanges (please specify)其它交易所 (请注明) _____ _____	<input type="checkbox"/> < 20 <input type="checkbox"/> 20 – 50 <input type="checkbox"/> > 50	<input type="checkbox"/> Nil 无 <input type="checkbox"/> < 1 <input type="checkbox"/> 1 – 5 <input type="checkbox"/> > 5
Other products (please specify) 其它产品(请注明) _____ <input type="checkbox"/> Hong Kong 香港 <input type="checkbox"/> other exchanges (please specify)其它交易所 (请注明) _____ _____	<input type="checkbox"/> < 20 <input type="checkbox"/> 20 – 50 <input type="checkbox"/> > 50	<input type="checkbox"/> Nil 无 <input type="checkbox"/> < 1 <input type="checkbox"/> 1 – 5 <input type="checkbox"/> > 5

Signed by 客户签署:

 Signature 签署
 Name 姓名

 Date日期

风险披露声明 - 在交易所买卖衍生产品

以下风险披露声明不能披露所有涉及的风险。在进行交易或投资前，阁下应就该投资进行本身资料搜集及研究。阁下应按本身的财政状况及投资目标谨慎考虑是否适宜进行交易或投资。

在交易所买卖衍生产品是指在交易所上市或买卖的衍生产品，包括但不限于期货合约，期权合约，认股权证，可赎回牛/熊合约（下称“交易所衍生产品”）。

- (a) 交易所衍生产品之流动性不可预测。交易所衍生产品上市并不必然导致比未上市的衍生产品有更大流动性；
- (b) 对于涉及在交易所交易的合约或工具之投资交易，当某些情况（如交易所或结算所正常的市场运作或条件中断，某些合约或工具交易的暂停或限制，以及/或者影响上述交易抛售或相关资产流动性的其它事件）发生，亏损的风险可能会增加；
- (c) 在某些情况下，交易所买卖合约或工具的规范可能由有关交易所或结算所进行修订，而且此修订可能会对阁下的投资造成不利影响；
- (d) 倘若发行人破产并对上市证券违约，阁下将被视为无担保债权人，并对发行人持有的任何资产没有优先追索权。因此您应当密切关注发行人之经济实力和信用；
- (e) 无担保交易所衍生产品是名义资产担保的。若发行人破产，阁下会丧失所有投资。您应当阅读上市文件以确定产品是否有担保；
- (f) 场外衍生产品通常涉及到很高的杠杆率，因此基础证券的价格出现相对轻微的波动会导致交易所衍生产品价格出现不成比例之大幅波动。场外衍生产品的价值不是固定的，而是会随着市场波动，会受到许多因素的影响，包括经济和/或政治环境的变化。因此衍生产品的价格会波动，并且可能跌至零，导致初始投资的完全损失。此外，交易所衍生产品的价格可能因市场供求因素等外部影响而与其理论价格不匹配。因此，实际交易价格可能高于或低于理论价格。
- (g) 交易所衍生产品有到期日，在该日期后它们可能会变得毫无价值。阁下必须了解产品的有效时间范围，并为交易策略选择一种有效期合适的产品。特别是，衍生权证的价值会随着逐渐趋近其到期日期而贬值，因此，衍生权证不应被看作是长期投资；
- (h) 投资者应当清楚基础资产波动性买卖基础资产为非港币计价的交易所衍生产品的投资者还将负担汇率风险。汇率波动对基础资产的价值会产生不利影响，也会影响到交易所衍生产品的价格；
- (i) 交易所要求所有结构性产品发行人为每一次发行指定流动性提供商。流动性提供商的责任是提高双向报价以便于产品交易。如果一家流动性提供商未能或停止履行其责任，那么只有在指定新的流动性提供商后，您才能购买或销售该产品。
- (j) 一些交易所衍生产品具有即日取消或强制赎回特点。当基础资产价值等于强制赎回价或达到上市文件中规定的水平，此等交易所衍生产品将停止交易。阁下仅仅有权享有终止交易之衍生产品剩余价值，此价值由产品发行商按照上市文件规定计算。阁下也应当知道剩余价值可能为零。此外，交易所衍生产品的发行价格还包括其资金成本。资金成本会因交易所衍生产品趋于到期而逐渐降低。交易所衍生产品的持续时间越长，其总资金成本越高。当此等交易所衍生产品被赎回时，您将损失此等交易所衍生产品整个有效期内的资金成本。阁下应当参考上市文件中列出的计算资金成本的公式。

客户签署：

签署
姓名

日期