

江苏双星彩塑新材料股份有限公司

期货交易管理及信息报告制度

第一章 总则

第一条 为加强江苏双星彩塑新材料股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）期货业务的管理，积极稳妥参与 PTA 及 MEG 期货交易，有效防范和化解经营风险，根据各期货交易所有关期货交易规则、《企业内部控制基本规范》及国家有关法律、法规和《公司章程》、公司《期货套期保值交易管理制度》的规定，制定本制度。

第二条 本制度同时适用于本公司下属全资或控股子公司。

第二章 组织结构

第三条 公司成立 PTA 及 MEG 期货业务领导小组，负责管理公司 PTA 及 MEG 期货业务相关事宜。由总经理或其指定负责人、财务总监、董事会秘书、内控审计部负责人、风险管理部负责人等相关人员共同组成。其职责包括：

（一）定期召开期货业务领导小组会议，听取相关负责人的工作报告，批准授权范围内的期货操作方案；

（二）对公司期货业务进行监督管理，对公司期货的风险进行管理控制；

（三）期货业务突发风险的应急处理；

（四）向董事会汇报期货业务工作开展情况；

（五）行使董事会授予的其他职责。

第四条 期货领导小组下设“期货操作小组”和“风险管理员”，各岗位主要职责如下：

（一）期货操作小组的主要职责：

1、制定、调整期货交易方案，并报期货领导小组审批；

2、执行具体的期货交易；

3、向期货领导小组汇报并提交书面工作报告；

4、其他日常管理和联系工作。

5、履行期货领导小组授予的其他职权。

（二）风险管理员的主要职责：

- 1、审查期货交易方案是否符合相关规定；
- 2、负责监督交易的执行情况，并不定期进行抽查；
- 3、对期货头寸风险状况进行监控和评估，保证期货业务的正常进行；
- 4、发现不合规操作或风险情况直接向期货领导小组汇报。
- 5、履行期货领导小组授予的其他职权。

第五条 期货操作小组各岗位人员应进行有效分离，不得交叉或越权行使其职责，确保能够相互独立并监督制约。

第三章 审批权限

第六条 进行期货交易的单笔或累计保证金额度按照公司整体现货经营量并严格遵守本制度的各项要求执行。期货业务的方案和保证金额度需遵循《深圳证券交易所股票上市规则》等相关法律法规的规定及《公司章程》等内部管理制度的相关规定，提交公司董事会审批。在公司董事会的经营决策权限内，由董事会审议批准后实施；未达董事会审议权限的事项，授权总经理进行审批；如超出《公司章程》规定的董事会决策权限，则应提交股东大会审议通过后方可进行。

第七条 公司对期货业务交易操作实行授权管理。交易授权书应列明有权交易的人员名单、可从事交易的具体种类和交易限额、授权期限。期货交易授权书由公司董事长签发。被授权人员应当在授权书载明的授权范围内诚实并善意地行使该权利。如因任何原因造成被授权人变动的，授予该被授权人的权限应即时予以调整，并应立即由授权人通知业务相关各方。自通知之时起，被授权人不再享有原授权书授予的一切权利。

第四章 期货业务流程

第八条 期货操作小组应当根据董事会或股东大会审批通过的年度期货套期保值业务方案和保证金额度范围内，结合现货的具体情况和市场价格行情，拟订期货交易方案后执行。期货交易方案应包括以下内容：期货交易的建仓合约、价位区间、数量、拟投入的保证金、风险分析、风险控制措施、止损额度等。

第九条 期货交易人员根据期货交易方案，填写注入或追加保证金的付款通知，根据公司相关资金审批制度规定审批同意后执行付款。并且监督资金风险状况，若出现资金风险应第一时间通知资金调拨人追加资金。资金划拨按公司资金操作流程处理。期货交易人员应根据交易方案下达交易指令，成交确认后，交易

人员应填写交易明细表，包括交易时间、交易品种、交易价格、交易量、交割期等内容。

第十条 风险管理人员实时跟踪期货操作情况，若与期货交易方案不符，须立即报告公司期货领导小组。

第十一条 结算专员每交易日结算后与交易员核对保证金余额，结算专员每月末收到交割单或结算单并审核无误，并经公司财务负责人同意后，进行账务处理。风险管理人员应核查交易明细表是否与代理机构发来的结算单相一致，核查无误后，风险管理人员应向代理机构和会计核算人员发送经被授权人签字的交易确认，并通知财务人员依据公司财务制度进行相应的资金收付。

第十二条 期货操作小组定期进行期货业务综合评价，并向期货领导小组进行汇报。

第五章 交割管理

第十三条 公司期货操作小组结合现货的具体情况和市场价格行情，决定是否进行交割；交割具体事宜由期货领导小组指定专人根据有关规定进行操作。

第六章 风险管理

第十四条 公司操作小组的人员在从事期货业务时应亲自操作并严格根据授权范围执行，不得转授权，不得超载授权权限。

第十五条 公司在开展期货业务前，应严格按照本制度的规定合理设置期货业务组织机构和选择安排相应岗位业务人员。

第十六条 公司设置风险管理员岗位，风险管理员直接对公司期货领导小组负责。

第十七条 公司期货操作小组任何时候不得超过董事会授权范围进行操作。

第十八条 公司建立风险测算系统如下：

（一）资金风险：测算已占用的保证金数量、浮动盈亏、可用保证金数量及拟建头寸需要的保证金数量、公司对可能追加的保证金的准备数量；

（二）期货头寸价格变动风险：根据公司期货交易方案测算已建仓头寸和需建仓头寸在价格出现变动后的保证金需求和盈亏风险。

第十九条 公司应建立内部风险报告制度和风险处理程序：

（一）当市场价格波动较大或发生异常波动的情况时，交易员应立即报告期

货操作小组组长和风险管理员，并立即报告公司期货领导小组；

（二）当发生以下情况时，风险管理员应立即向公司期货领导小组报告：

- 1、公司的具体期货交易方案不符合有关法律法规规定；
- 2、公司交易员的交易行为不符合期货交易方案；
- 3、公司期货头寸的风险状况影响到期货交易的正常进行；
- 4、公司期货业务出现或将出现有关的法律风险。
- 5、发生其他存在较大风险的情形

第二十条 期货领导小组如发现期货交易存在违规操作时，应立即终止违规人员的授权手续，并及时调查违规事件的详细情况，制定和实施补救方案。

第二十一条 公司的风险处理程序如下：召开公司期货领导小组和有关人员参加会议，分析讨论风险情况及应采取的对策；相关人员执行公司期货领导小组的风险处理决定。

第七章 信息报告制度

第二十二条 期货操作小组向开户机构提供和及时更新负责期货交易的部门主管人员及相关业务人员信息。

第二十三条 建立期货交易的内部报告制度。期货操作小组应制作期货业务日报表，向期货领导小组等报告当日交易情况、交易结算情况、资金使用情况及浮动盈亏等，以确保公司相关部门与人员及时掌握必要的业务、风险和管理信息。每月向期货领导小组等报告期货投资策略或套期保值方案执行情况、盈亏情况、风险监控情况和其他重大事项等。

第八章 保密与档案管理

第二十四条 公司期货业务相关人员应遵守公司的保密规定。

第二十五条 公司期货业务相关人员未经允许不得泄露本公司的期货交易方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司期货交易有关的信息。

第二十六条 期货业务相关人员及其他因工作关系接触到与资产管理业务的期货交易有关信息的工作人员，负有严格保密的责任和义务，由个人原因造成信息泄露并产生的任何不良后果由当事人负全部责任，同时将严厉追究当事人责任。

第二十七条 公司进行期货业务的原始资料，包括但不限于申请、审批、开户、交易、结算等文件，应当作为业务档案归档，保存期限为 10 年。

第九章 附则

第二十八条 本制度未尽事宜，依据国家有关法律、行政法规、部门规章和其他规范性文件、《公司章程》、《期货套期保值交易管理制度》以及公司有关制度执行。本制度如与日后颁布的有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件的规定相抵触的，应按届时有效的有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件的规定执行，并由董事会及时修订本制度。

第二十九条 本制度由公司董事会负责制定及解释，经公司董事会审议通过后生效并实施，修订时亦同。

江苏双星彩塑新材料股份有限公司

2020 年 4 月