

## 山东海化股份有限公司期货业务管理制度

(本制度已经第八届董事会 2022 年第四次会议审议通过。)

2022 年 10 月

## 目 录

1	目的 .....	3
2	适用范围 .....	3
3	编制依据 .....	3
4	机构和职责 .....	3
5	基本原则 .....	4
6	审批权限 .....	5
7	风险控制 .....	5
8	信息披露 .....	6
9	保密及档案管理制度.....	7
10	附则 .....	7

## 1 目的

为规范山东海化股份有限公司（以下简称“公司”）期货业务交易监管流程，防范期货业务中的各类风险，根据国家有关法律法规和公司章程的规定，特制定本制度。

## 2 适用范围

本制度适用于公司本部及下属分子公司。未经公司同意，分子公司不得开展期货业务。

## 3 编制依据

3.1 《中华人民共和国期货和衍生品法》，2022年4月20日第十三届全国人民代表大会常务委员会第三十四次会议通过。

3.2 《关于印发〈市属企业高风险业务管理指导意见〉的通知》，潍国资发〔2021〕60号，2021，潍坊市国资委。

3.3 《山东海化股份有限公司章程》，2021，公司。

## 4 机构和职责

### 4.1 董事会

公司董事会是期货业务的主要决策机构，其主要职责为：

- a) 授权组建公司期货领导小组；
- b) 审议批准公司期货业务管理制度；
- c) 负责公司期货业务准入审批，核准开展期货业务的相关事项；
- d) 审议批准其他与期货业务相关的重要事项。

### 4.2 期货领导小组

董事会授权总经理组建公司期货领导小组，主管公司期货业务。由公司总经理、财务总监、分管销售副总经理、销售分公司负责人及市场部负责人组成，其主要职责为：

- a) 对公司期货业务进行监督管理；
- b) 审核期货业务管理制度；

- c) 期货业务突发风险的应急处理；
- d) 拟定公司开展期货业务及相关事项，提交董事会审核批准；
- e) 在董事会授权范围内，审批公司年度期货业务计划和期货业务方案；
- f) 向董事会汇报公司期货业务的开展情况；
- g) 履行董事会授予的其他职责。

#### 4.3 市场部

市场部为期货业务归口管理部门，其主要职责为：

- a) 建立健全公司期货业务管理制度和办法；
- b) 审核年度期货业务计划和期货业务方案；
- c) 对期货业务执行情况监控，对期货业务风险进行管控；
- d) 组织开展期货业务套保效果评估，总结评价风险管理情况并向期货领导小组汇报；
- e) 履行期货领导小组授予的其他职责。

#### 4.4 销售分公司

销售分公司为期货业务操作主体，其主要职责为：

- a) 建立健全期货业务操作和风险控制细则；
- b) 根据期货业务具体情况设置权责清晰的职能部门或岗位，但业务操作实施与风险控制不得由同一岗位兼任；
- c) 负责期货业务的组织和具体实施，对业务风险进行监控；
- d) 定期向期货领导小组报告期货业务工作进展及风险应对事项。

### 5 基本原则

5.1 公司的期货业务仅限于公司生产产品的套期保值业务，目的是充分利用期货市场的风险规避、价格发现功能，有效防范和对冲产品市场价格剧烈波动带来的风险。

5.2 开展套期保值业务要严守套期保值原则，以降低实货风险敞口

为目的，套期保值的品种、额度、方向、期限要与现货相匹配，不得开展或变相开展任何形式的投机和套利交易，不得盲目从事长期业务或展期。

5.3 公司应严格控制期货交易的种类及规模，以套期保值和防范减值风险为主要目的，不得影响公司正常经营。

5.4 公司应当以自身名义设立期货交易账户，不得使用他人账户进行期货交易，自有交易账户也不得为他人提供交易服务。

5.5 公司应具有与期货业务保证金相匹配的资金，其资金使用不得违反国家法律法规和中国证监会、证券交易所相关规定。

5.6 公司应制定期货交易业务会计政策，确定期货交易业务的计量及核算方法。

## **6 审批权限**

6.1 公司股东大会、董事会及期货领导小组为期货业务的审批机构。

6.2 公司年度期货套期保值投资额度（含追加的临时保证金）由期货领导小组拟定，审批权限按照公司章程相关规定执行。年度期货交易品种、工具、场所等事项由公司董事会核准。

6.3 公司年度期货业务计划、期货业务方案由期货领导小组审议批准。

6.4 公司的期货业务须由审批机构审批通过后方可执行，如需调整，必须重新履行审批程序。

6.5 经审批后的期货套期保值总额度可以在 12 个月内实施循环交易。

## **7 风险控制**

7.1 公司开展期货业务须对相关风险保持必要关注：

- a) 严格遵守国家法律法规，制定切合实际的业务计划；
- b) 严格按照规定程序进行保证金及清算资金的收支；

- c) 建立持仓预警报告和交易止损机制，防止交易过程中由于资金收支核算和套期保值盈亏计算错误而导致财务报告信息的不真实；
- d) 防止因重大差错、舞弊、欺诈而导致损失；
- e) 确保交易指令准确、及时、有序记录和传递。

## 7.2 期货交易的风险处置与管理

当出现以下情形时，销售分公司应及时上报，并提交分析建议报告：

- a) 期货相关品种的价格出现与建仓方向相反的涨跌停；
- b) 期货账户存在被强制平仓的可能，需要补交保证金；
- c) 期货经纪商存在违约风险；
- d) 期货业务出现或将出现有关的法律风险；
- e) 期货业务方案规定的其他情形。

7.3 公司参与期货业务的所有人员应当充分了解期货风险，严格执行期货交易的业务操作和风险管理制度。

7.4 期货业务操作环节相互独立，相关人员相互独立，不得由单人负责业务操作的全部流程。

7.5 公司应选择在国家批准的、具有良好资信和业务实力的期货经纪公司开立期货账户，并随时跟踪了解期货经纪公司的发展变化和资信情况。

7.6 公司应严格按照规定安排和使用期货业务人员、风控专员，加强职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

7.7 公司应定期或不定期对期货业务开展情况进行监督检查。

## 8 信息披露

8.1 公司应按照深圳证券交易所《股票上市规则》等相关法规和规范性文件，履行信息披露义务。

8.2 公司为进行套期保值而指定的期货的公允价值变动与被套期项目的公允价值变动相抵销后，导致合计亏损或浮动亏损金额每达到公司最近一年经审计的归属于上市公司股东净利润的 10%且绝对金额超过 1000 万元人民币的，应当在两个交易日内及时披露。

## **9 保密及档案管理制度**

9.1 公司期货业务相关人员应遵守公司的保密规定。

9.2 公司期货业务相关人员不得泄露本公司的期货方案、交易情况、结算情况、资金状况等与期货交易有关的信息。

9.3 公司进行期货业务的开户文件、授权文件、交易原始资料、结算资料等档案应妥善保存。

## **10 附则**

10.1 本制度未尽事宜，依照相关法律法规、规范性文件及公司章程规定执行，本制度如与国家颁布的法律、法规或经合法程序修改后的公司章程相抵触时，执行国家法律、法规和公司章程的规定。

10.2 本制度自公司董事会审议通过后生效。

10.3 本制度由公司董事会负责解释。

**【正文结束】**