

山东海化股份有限公司期货业务管理制度

(本制度已经第九届董事会 2025 年第一次会议审议通过)



2025 年 3 月

目 录

| | |
|---------------------|---|
| 第一章 总 则 | 3 |
| 第二章 期货业务的基本原则 | 3 |
| 第三章 组织机构和职责 | 3 |
| 第四章 风险控制及信息披露 | 5 |
| 第五章 保密及档案管理 | 6 |
| 第六章 附 则 | 7 |

第一章 总 则

第一条 为规范山东海化股份有限公司（以下简称“公司”）期货业务管理，有效防范和化解期货业务风险，根据《中华人民共和国期货和衍生品法》等法律法规、规范性文件和公司章程的规定，特制定本制度。

第二条 本制度适用于公司及下属分子公司。未经公司同意，分子公司不得开展期货业务。

第三条 本制度所指期货业务包含商品期货业务和商品期权业务。

第二章 期货业务的基本原则

第四条 公司期货业务应以套期保值为目的，仅限于公司主业经营密切相关的品种，目的是借助期货市场的风险对冲功能，利用期货及期权工具规避市场价格波动风险，保证公司生产经营的稳定性和可持续性。

第五条 公司期货业务应严守套期保值原则，期货交易的品种、数量、额度、方向、期限要与现货相匹配，不得盲目从事长期业务或展期，不得开展或变相开展任何形式的投机和套利交易。

第六条 公司应严格控制期货交易的种类及规模，不得影响公司正常经营。

第七条 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。

第八条 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、交易所相关规定。

第九条 公司应制定期货业务会计政策，确定期货业务的计量及核算方法。

第三章 组织机构和职责

第十条 公司董事会是期货业务的决策机构，其主要职责为：

- （一）授权组建公司期货领导小组；
- （二）审议批准公司期货业务管理制度；

(三) 负责公司期货业务准入审批，核准年度开展期货业务的相关事项；

(四) 审议批准其他与期货业务相关的重要事项。

第十一条 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，其主要职责为：

- (一) 审核公司期货业务管理制度；
- (二) 审核公司年度开展期货业务的相关事项；
- (三) 审批公司年度期货业务计划和具体的期货业务方案；
- (四) 对公司期货业务的整体运营进行监督管理；
- (五) 负责期货业务突发风险的应急处理；
- (六) 向董事会汇报公司期货业务的开展情况；
- (七) 履行董事会授予的其他职责。

第十二条 经营管理部为期货业务归口管理部门，其主要职责为：

- (一) 建立健全公司期货业务管理制度和办法；
- (二) 审核年度期货业务计划和具体的期货业务方案；
- (三) 对期货业务执行情况进行监控，对期货业务风险进行管控；
- (四) 组织期货业务套保效果评估；
- (五) 组织期货领导小组会议，履行期货领导小组授予的其他职责。

第十三条 销售分公司为公司期货业务操作平台，其主要职责为：

- (一) 建立健全期货业务操作和风险控制细则；
- (二) 提出期货业务需求，编制可行性分析报告；
- (三) 编制年度期货业务计划和具体的期货业务方案；
- (四) 负责公司期货业务的组织和具体实施；
- (五) 负责对期货业务风险进行识别、监控、报告和处理；
- (六) 向期货领导小组报告期货业务工作进展及风险应对事项。

第十四条 公司股东会、董事会及期货领导小组为期货业务的审批机

构。

第十五条 公司年度期货交易品种、工具、场所等事项由公司董事会核准。年度期货套期保值投资额度（含追加的临时保证金）由期货领导小组确定，审批权限按照公司章程相关规定执行。

属于下列情形之一的，应当在董事会审议通过后提交股东会审议：

（一）预计动用的交易保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）占公司最近一期经审计净利润的 50%以上，且绝对金额超过五百万元人民币；

（二）预计任一交易日持有的最高合约价值占公司最近一期经审计净资产的 50%以上，且绝对金额超过五千万元人民币。

经审批后的套期保值总额度可以在 12 个月内实施循环交易，期限内任一时点的金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不应超过已审议额度。

第十六条 公司年度期货业务计划、具体的期货业务方案由期货领导小组审议批准。

第十七条 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。

第四章 风险控制及信息披露

第十八条 公司开展期货业务须对相关风险保持必要关注；严格遵守相关制度规定，制定切合实际的业务计划；合理计划和安排使用保证金，按程序进行保证金的测算和划拨；建立风险预警和处置机制，及时预防、发现和化解风险；严格按照工作程序进行交易操作，防止因重大差错、舞弊、欺诈而导致损失。

第十九条 当出现以下情形时，销售分公司应及时上报期货领导小组，进行风险处置：

- (一) 期货相关品种的价格连续出现与建仓方向相反的涨跌停；
- (二) 期货账户存在被强制平仓的可能；
- (三) 期货经纪商存在违约风险；
- (四) 期货业务出现或将出现有关的法律风险；
- (五) 期货业务方案规定的其他情形。

第二十条 公司参与期货业务的所有人员应当充分了解期货风险，严格执行期货业务和风险管理相关制度。

第二十一条 公司应根据期货业务具体实施情况设置权责清晰的职能部门或岗位，严格执行不相容岗位及人员分离原则。

第二十二条 公司应强化内控执行，严格合规管理，规范开展授权审批、交易操作、资金使用。

第二十三条 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，防止发生交易违约风险。

第二十四条 公司应严格按照规定安排和使用期货业务人员、风控人员，加强职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

第二十五条 公司应定期或不定期对期货业务开展情况进行监督检查。

第二十六条 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的要求履行信息披露义务。

第五章 保密及档案管理

第二十七条 公司期货业务相关人员应遵守公司的保密规定。

第二十八条 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。

第二十九条 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。

第六章 附 则

第三十条 本制度未尽事宜，或与其他法律法规、部门规章、规范性文件或公司章程相悖时，应按照上述法律法规、部门规章、规范性文件和公司章程执行。

第三十一条 本制度自董事会审议通过之日起生效实施，修改亦同。

第三十二条 本制度由董事会负责解释。

山东海化股份有限公司

2025年3月6日