



青岛汇金通电力设备股份有限公司

期货套期保值业务管理制度

第一章 总则

第一条 为规范青岛汇金通电力设备股份有限公司（以下简称“公司”）期货套期保值业务（以下简称“套保”），有效防范交易风险，维护公司及股东利益，根据《中华人民共和国证券法》、《上市公司信息披露管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》、《上海证券交易所上市公司内部控制指引》等法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的有关规定，结合公司的实际情况，特制定本制度。

第二条 公司进行套保业务的目的是为规避原材料市场价格波动带来的经营管理风险，实现风险对冲，保证公司业务相对稳定。

第三条 本制度适用于公司及全资或控股子公司，全资或控股子公司进行期货套期保值业务视同公司进行期货套期保值业务。公司全资或控股子公司的期货套期保值业务由公司进行统一管理、操作，公司统筹管理期货头寸，并进行相应的套期保值。未经公司同意，公司下属全资及控股子公司不得操作该业务。

第四条 公司进行套保业务，应遵循以下原则：

- （一）从事期货套保业务的品种，只限于与公司生产经营相关的大宗原材料，不接受其他任何单位的委托和代理期货业务，不进行投机交易。
- （二）公司进行套保业务，只限于在期货交易所进行场内市场交易，不得进行场外市场交易。
- （三）公司应以公司及子公司名义设立套期保值交易账户，不得使用他人账户进行套期保值业务。
- （四）套保业务保证金应与公司的自有资金相匹配，不得使用募集资金直



接或间接进行套期保值。公司应根据现货业务经营匹配控制套保业务的资金规模，不得影响公司正常经营。

- (五) 公司套期保值业务规模不超过年度预算采购和销售计划的 30%。
- (六) 公司在进行期货套期保值业务时，应严格遵守相关法律、法规和规范性文件与期货交易的规定，不得进行违法违规的交易。

第二章 组织机构及职责

第五条 公司董事会授权董事长或总经理组建期货套期保值领导小组（以下简称“领导小组”），成员包括：董事长、总经理、采购副总经理、销售副总经理、财务总监、内审部负责人。

第六条 期货领导小组的职责为：

- (一) 负责对公司从事期货套期保值业务进行监督管理。
- (二) 负责召开期货领导小组会议，制订年度套期保值计划，并提交董事会审议。
- (三) 听取小组下设办事机构的工作报告，批准授权范围内的套期保值交易方案。
- (四) 负责审定公司套期保值管理工作的各项具体规章制度，决定工作原则和方针。
- (五) 负责交易风险的应急处理。
- (六) 行使董事会授予的其他职责。

第七条 领导小组下设套保业务工作小组（以下简称“工作小组”），设交易员、档案管理员、资金结算员、会计核算员、风险控制员等岗位，各岗位人员应有效分离，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。工作小组的职责为：

- (一) 制订、调整套期保值计划、交易方案，并报期货领导小组审批。
- (二) 执行具体的套期保值交易。



(三) 向期货领导小组汇报并提交书面工作报告。

(四) 其他日常联系和管理工作。

其中，风险控制员的主要职责：

(一) 审查期货套期保值方案是否符合相关规定；

(二) 负责监督交易的执行情况，并不定期进行抽查；

(三) 对期货头寸的风险状况进行监控和评估，保证期货套期保值业务的正常进行；

(四) 发现不合规操作或风险情况直接向领导小组汇报。

第三章 期货套期保值业务的审批权限

第八条 公司进行期货交易的单笔或累计保证金额度按照《公司章程》、《对外投资管理制度》中所规定对外投资审批权限提交公司董事会或股东大会批准。

董事会授权期货套期保值领导小组执行期货套期保值业务。各项期货套期保值业务必须严格限定在经批准的期货套期保值计划内进行，不得超范围操作。

第四章 授权制度

第九条 公司与期货经纪公司订立的开户合同应按公司有关合同管理规定及程序审核后，由公司法定代表人或经法定代表人授权的人员签署。

第十条 公司对期货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法定代表人签发。

第十一条 被授权人员应当在授权书载明的权利范围内诚实并善意地行使该权利。
只有授权书载明的被授权人才能行使该授权书所列权利。

第十二条 如因各种原因造成被授权人的变动，授予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。被授权人自通知之时起，不再享有原授权书授予的一切权利。

第五章 业务流程

第十三条 期货套保工作小组结合公司近期经营规模等原材料需求的具体情况和市场价格行情，制定期货套期保值交易方案，报经公司期货套保领导小组批准后方可执行。交易方案应包括以下内容：套期保值交易的建仓品种、价位区间、数量、拟投入的保证金、风险分析、风险控制措施、止损区间、价位及额度等。期货套保领导小组批准后的交易方案应报送证券部、财务部等相关部门备案。

第十四条 交易员根据批准的方案，填写注入或追加保证金的付款通知，由风险控制员审核，经期货套保工作小组负责人及财务部相关主管审批同意后交资金调拨员执行付款。会计核算员根据银行的单据进行账务处理。交易员根据公司的套期保值方案选择合适的时机向期货经纪公司下达交易指令。

第十五条 每笔交易结束后，交易员应于 1 个交易日内及时将期货经纪公司交易系统生成的交易账单打印并传递给期货套保工作小组负责人、风险控制员进行审核。

第十六条 风险控制员核查交易是否符合套期保值方案，若不符合，须立即报告公司期货套保领导小组。

第十七条 会计核算员收到交割单或结算单并审核无误，并经财务部相关主管签字同意后，进行账务处理。会计核算员每月末与交易员核对保证金余额。

第十八条 期货套保工作小组根据公司运行规模要求和客户订单数量测算套保材料订单的实际采购情况拟订平仓方案，报期货领导小组批准后参照上述流程执行。

第六章 风险管理制度



第十九条 公司应建立严格有效的风险管理制度，利用事前、事中及事后的风险控制措施，预防、发现和化解风险。

第二十条 公司在开展期货套期保值业务前须做到：

(一) 慎重选择期货经纪公司；

(二) 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：

1、公司期货业务岗位设置应严格按照本制度“第二章组织机构及职责”执行；

2、期货业务人员要求：

(1) 有期货专业知识及管理经验、有良好的职业道德；

(2) 有较高的业务技能，熟悉期货交易相关的法律、法规，遵守法律、法规及交易的各项规章制度，规范自身行为，杜绝违法、违规行为。

第二十一条 公司的期货业务开户及经纪合同签订程序如下：

(一) 期货套保工作小组选择三家以上具有良好资信和业务实力、运作规范的期货经纪公司，经资格审查后推荐给期货领导小组作为候选单位；

(二) 期货领导小组从候选单位中选定公司期货交易的经纪公司；

(三) 公司法定代表人或经法定代表人书面授权的人员代表公司与期货经纪公司签订期货经纪合同书，并办理开户手续。

第二十二条 期货套保工作小组应随时跟踪了解期货经纪公司的发展变化和资信情况，并将有关发展变化报告公司期货领导小组，以便公司根据实际情况来决定是否更换期货经纪公司。

第二十三条 在实际业务操作中，呈批的方案中必须披露相关风险；交易方案须采取合理的交易策略，降低追加保证金的风险。



第二十四条 公司内审部应每季度定期或不定期地对套期保值业务进行检查，监督套期保值业务人员执行风险管理政策和风险管理工作程序，及时防范业务中的操作风险。

第二十五条 公司设置风险控制员岗位，风险控制员直接对公司期货领导小组和董事长负责。风险控制员岗位不得与期货套保工作小组的其他岗位交叉。

第二十六条 风险控制员须严格审核公司的期货套期保值业务是否是为公司生产所需的原材料或与所需原材料相关的品种进行的保值，若不是，则须立即报告公司期货领导小组。

第二十七条 公司建立以下内部风险报告制度和风险处理程序：

（一）内部风险报告制度：

1、交易员应于每天收市后将已占用的保证金金额、浮动盈亏、可用保证金数量及拟建头寸需要追加的保证金数量，形成专门报告或标准帐表，并及时上报公司期货领导小组。

2、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套保工作小组负责人和风险控制员；如果交易合约市值损失接近或突破止损限额时，应该立即启动止损机制；如果发生追加保证金等风险事件，期货套保工作小组应立即向期货领导小组报告，并在 24 小时内提交分析意见，由期货领导小组做出决策。同时，根据本制度及公司《重大信息内部报告制度》及时向董事会及董事会秘书报告。

3、当发生以下情况时，风险控制员应立即向公司期货领导小组报告：

（1）期货业务有关人员违反风险管理政策和风险管理工作程序；

（2）期货经纪公司的资信情况不符合公司的要求；

（3）公司的具体保值方案不符合有关规定；

（4）交易员的交易行为不符合套期保值方案；



(5) 公司期货头寸的风险状况影响到套期保值过程的正常进行；

(6) 公司期货业务出现或将出现有关的法律风险。

4、期货领导小组、工作小组的任何人员，如发现套期保值交易存在违规操作时，应立即向期货领导小组汇报。同时，期货领导小组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。

(二) 风险处理程序：

1、期货套保工作小组负责人及时召集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；

2、相关人员执行公司的风险处理决定。

第二十八条 交易错单处理程序：

(一) 当发生属期货经纪公司过错的错单时：由交易员及时通知期货经纪公司，并报告期货领导小组，责成经纪公司采取相应处理措施，再向期货经纪公司追偿产生的损失；

(二) 当发生属于公司交易员过错的错单时：交易员应立即报告套期保值套保工作小组负责人，并下达相应的指令，相应的交易指令要求能消除或尽可能减少错单对公司造成的损失。

第二十九条 公司应合理计划和安排使用保证金，保证套期保值过程正常进行。

应合理选择保值月份，避免市场流动性风险；

第三十条 公司应严格按照规定安排和使用期货业务人员，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

第三十一条 公司设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展。

第七章 报告制度



第三十二条 期货套保工作小组于月初向期货领导小组提交上月套期保值业务报告，包括本月新建仓位状况、总体持仓状况、结算状况、套期保值效果、未来价格趋势及相关分析。

第三十三条 套期保值业务人员应遵守以下汇报制度：

- (一) 交易员每次交易后向期货套保工作小组负责人、风险控制员、公司期货领导小组报告每次新建头寸情况、计划建仓及平仓头寸情况及最新市场信息等情况。
- (二) 交易员和会计核算员分别根据每次交易情况建立套期保值统计核算台帐并向财务总监及风险控制员报告汇总持仓状况、结算盈亏状况及保证金使用状况等信息。

第八章 期货套期保值业务的信息披露

第三十四条 公司对前述期货套期保值业务，需事前提交董事会审议。证券部在董事会做出相关决议后两个交易日内进行公告，并向上海证券交易所提交下列文件：

- (一) 董事会决议及公告；
- (二) 套期保值事项公告，公司披露的套期保值事项至少应当包括：套期保值的目的、期货品种、拟投入资金及业务期间、套期保值的风险分析及公司拟采取的风险控制措施等；
- (三) 上海证券交易所要求的其他文件。

第九章 档案管理制度

第三十五条 公司对期货套期保值的交易原始资料、结算资料等业务档案、期货业务开户文件、授权文件、各类内部报告、发文及批复文件等档案由档案管理员负责保管，保管期限至少 10 年。

第十章 保密制度

第三十六条 公司期货业务相关人员应遵守公司的保密制度。



第三十七条 公司期货业务相关人员未经允许不得泄露本公司的套期保值方案、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。公司套期保值业务的定期披露及临时披露内容由期货领导小组根据上市规则及相关法律法规的要求确定。

第十一章 责任追究

第三十八条 本制度所涉及的交易指令、资金拨付、结算、内控审计等各有关人员，严格按照规定执行的，风险由公司承担。违反本制度规定进行的资金拨付、下单交易等行为，或违反本制度规定的报告义务的，由行为人对风险或损失承担个人责任；公司将区分不同情况，给予行政处分、经济处罚直至追究刑事责任。

第十二章 附则

第三十九条 制度未尽事宜，依照国家有关法律、法规及其他规范性文件的规定执行。本制度如与日后颁布的有关法律、法规、规范性文件的规定相抵触的，按有关法律、法规、规范性文件的规定执行，并由董事会及时修订。

第四十条 本制度经公司董事会审议通过后生效实施，由董事会负责解释及修改。

青岛汇金通电力设备股份有限公司

二〇二〇年十二月四日