

上海爱旭新能源股份有限公司

期货套期保值业务管理制度

（经 2020 年 3 月 27 日召开的第八届董事会第五次会议审议通过）

第一章 总则

第一条 为规范上海爱旭新能源股份有限公司（以下简称“公司”）的期货套期保值业务及相关信息披露工作，加强期货套期保值业务的管理，有效发挥套期保值业务在公司原材料采购中规避价格风险的功能，健全和完善公司期货套期保值业务管理机制，根据相关法律法规，结合公司实际情况，制定本制度。

第二条 本制度适用于公司及子公司（包括但不限于控股子公司、全资子公司）的期货套期保值业务。公司及子公司应当按照本制度相关规定，履行相关审批和信息披露义务。未经公司有权决策机构审议通过，公司及子公司不得开展该业务。

第三条 公司开展期货套期保值业务的交易品种为与公司生产所需原材料相关的商品，如白银、铝等。

第二章 期货套期保值业务操作原则

第四条 公司期货套期保值业务应遵守以下基本原则：

（一）公司进行期货套期保值业务仅以规避价格风险为目的，利用套期保值工具规避实际生产经营中同类原材料价格波动风险，不得进行投机和套利交易。

（二）公司进行期货套期保值的数量、头寸规模、合约持有时间原则上应与实际生产需采购的同类原材料的数量、采购金额、采购时间相匹配。

第五条 公司（含下属子公司）应当在以公司名义设立套期保值交易账户中开展期货套期保值业务，不得使用他人账户进行相关业务操作。

第六条 公司不得使用募集资金直接或间接进行期货套期保值业务。公司应当严格控制套期保值业务的资金规模，不得影响公司正常生产经营。

第三章 审批权限

第七条 公司应在总经理办公会、董事会或股东大会的权限范围内开展期货套期保值业务。具体决策和审批权限如下：

（一）公司开展期货套期保值业务单次或连续十二个月内累计投入或调整的保证金金额未达到公司最近一期经审计净资产10%的，由总经理办公会审批。

（二）公司开展期货套期保值业务单次或连续十二个月内累计投入或调整的保证金金额达到或超过公司最近一期经审计净资产10%的，由董事会审批。

（三）公司开展期货套期保值业务单次或连续十二个月内累计投入或调整的保证金金额达到或超过公司最近一期经审计净资产50%的，需在董事会审议通过后提交股东大会审批。

第四章 内部操作流程

第八条 公司开展期货套期保值业务实行授权管理。对于达到董事会审批标准的期货套期保值业务，公司董事会授权董事长审批日常期货套期保值业务方案及签署期货套期保值业务相关合同。对于未达到董事会审批标准的期货套期保值业务，由公司总经理审批日常期货套期保值业务方案及签署期货套期保值业务相关合同。公司董事长或总经理亦可签署期货交易授权书指定其他人员办理相关业务，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。

第九条 公司应明确期货套期保值业务的风险管理、计划制定、资金筹集、业务操作等操作流程并做好相关档案资料的保管。经办人员依据指令完成期货开、平仓或交割工作、交易结算日报的复核、分析，并每日向总经理报告汇总持仓状况、结算盈亏状况及保证金使用状况等信息。

第十条 期货套期保值业务的内部操作流程为：

1、公司在接到中标通知书或签订原材料采购合同时，公司套期保值业务经办人员根据实际套期保值需要制定相应期货套保计划，包括套保品种、数量、单价、交货期等。

2、公司套期保值业务经办人员以稳健为原则，通过期货市场调查、研究和判断，对拟进行的期货交易的品种、价位区间、数量、拟投入的保证金、交割期限、风险、风险控制措施、止损额度等进行分析，提出保值方案，上报总经理。

3、总经理对期货套期保值交易方案进行审核，并在权限范围内做出审批决定。

对于超过总经理审批权限的期货业务，需提交给公司董事会审议决定，董事会审批通过后，由董事长在授权范围内做出审批决定。

4、相关期货套期保值方案经董事长或总经理批准后，方可与合作机构签订合同并进行资金划拨及其他业务操作。公司套期保值业务经办人员根据交易账户资金占用情况，依据经批准的保值申请书提出资金申请计划，由资金管理部负责人审核，报总经理签字批准后，由资金管理部及时将资金调拨至公司期货专用账户。

5、公司套期保值业务经办人员依据经批准的保值申请书，选择合适的时机进行交易。每日应核对交易结算日报，防止出现透支开仓或被交易所强制平仓的情况发生；负责实时看盘，分析行情趋势，行情有异动时及时逐级上报至总经理。

6、公司套期保值经办人员在每天期货交易结束后，将当天的期货交易明细打印并存档管理。

7、公司应建立期货套期保值业务台账，登记每笔合约的持仓状况、结算盈亏状况及保证金使用状况等信息，并对公司期货套期保值业务开展情况持续关注，至少每月向总经理报告期货套期保值交易的相关情况。

第五章 保密

第十一条 参与公司期货套期保值业务的所有人员及合作的金融机构须履行信息保密义务，未经允许不得泄露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套期保值有关的信息。

第十二条 保值业务相关人员应对自己保管的文件资料和本人使用的计算机做好保密工作。

第六章 内部风险报告及风险处理

第十三条 公司利用事前、事中及事后的风险控制措施，预防、发现和化解风险。

第十四条 公司在开展期货套期保值业务前须慎重选择期货经纪公司，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。

第十五条 公司期货套期保值经办人员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总经理，以便公司根据实际情况来决定是否

更换期货经纪公司。

第十六条 公司按照不同月份的实际生产能力来确定和控制当期的套期保值量。

第十七条 公司在已经确认对实物合同进行套期保值的情况下，期货头寸的建立、平仓要与所保值的实物合同在数量上及时间上相匹配。

第十八条 当发生以下情况时，套期保值经办人员应立即逐级报告至总经理：

- （一）期货经纪公司期货业务有关人员违反交易协议及管理工作程序；
- （二）期货经纪公司的资信情况不符合公司的要求；
- （三）公司的具体保值方案不符合有关规定；
- （四）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；
- （五）公司期货业务出现或将出现有关的法律风险；
- （六）期货经纪公司交易员的交易行为不符合套期保值方案。

第十九条 风险处理程序：

1、总经理或其授权人及时召集公司有关人员参加会议，分析讨论风险情况及应采取的对策；

2、相关人员严格执行公司的风险处理决定。

第二十条 公司应合理计划和安排使用保证金，保证期货套期保值过程正常进行。应合理选择保值合约，避免市场流动性风险。

第二十一条 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。

第二十二条 公司设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。

第六章 信息披露

第二十三条 公司开展期货套期保值业务时，应按照中国证监会及上海证券交易所的相关规定，及时披露公司开展期货套期保值业务的信息。

第二十四条 当公司期货套期保值业务出现重大风险或可能出现重大风险，达到监管机构规定的披露标准时，公司应及时对外披露。

第七章 附则

第二十五条 本制度未尽事宜，按照中国的有关法律、法规、规范性文件执行。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，应按有关法律、法规、规范性文件的规定执行，并及时修订本制度。

第二十六条 本制度由公司总经理办公会负责制定、修改和解释，自公司董事会审议通过后生效并实施。

上海爱旭新能源股份有限公司

二〇二〇年三月二十七日