

# 宁波金田铜业（集团）股份有限公司

## 原材料期货及衍生品套期保值业务管理制度

### 第一章 总则

**第一条** 为规范宁波金田铜业（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）的原材料期货及衍生品套期保值业务，加强原材料套期保值业务的管理，防范交易风险，确保公司资产安全和套期保值有序进行，根据《上海证券交易所股票上市规则》及《宁波金田铜业（集团）股份有限公司公司章程》等相关规范性文件规定，并结合公司实际情况，制定本管理制度。

**第二条** 公司开展的原材料期货及衍生品交易以生产经营为基础，以套期保值为目的，不进行单纯以盈利为目的的投机和套利交易。本制度适用于公司及合并报表范围内子公司的原材料期货套期保值操作及其管理。

本制度所称期货交易是指以期货合约或者标准化期权合约作为交易标的的交易活动。本制度所述衍生品交易是指期货交易以外的，以互换合约、远期合约和非标准化期权合约及其组合为交易标的的交易活动。期货和衍生品的基础资产既可以是证券、指数、利率、汇率、货币、商品等标的，也可以是上述标的的组合。

**第三条** 公司应当以公司或子公司的名义设立期货和衍生品交易账户，不得使用他人账户进行期货和衍生品交易业务。

**第四条** 公司应当具有与期货和衍生品交易的交易保证金相匹配的自有资金，不得使用募集资金直接或间接进行期货和衍生品交易。公司应严格控制期货和衍生品交易的资金规模，不得影响公司正常经营。

### 第二章 组织机构设置及职责分工

**第五条** 公司原材料套期保值业务组织机构设置如下：

- （一）公司股东大会、董事会负责原材料套期保值业务的决策审批工作。
- （二）公司董事会审计委员会负责审查原材料期货和衍生品交易的可行性、必要性及风险控制情况，必要时可以聘请专业机构出具可行性分析报告。
- （三）公司原材料套期保值领导小组（以下简称“领导小组”）负责套期保值业务的全面领导和管理工作。

(四) 公司原材料套期保值业务小组负责业务操作和日常管理工作。

(五) 公司审计部主要负责对原材料套期保值业务的监督和审查。

(六) 公司董秘办主要负责原材料套期保值业务的信息披露工作。

**第六条** 公司设立原材料套期保值领导小组，领导小组由公司相关董事、高级管理人员组成，领导小组可授权小组成员行使其职权。主要职责：

(一) 制定套期保值计划或方案提交股东大会或董事会审批；

(二) 根据股东大会或董事会审批通过的原材料套期保值计划或方案，确定套期保值业务具体实施方案；

(三) 向公司董事会汇报套期保值工作情况；

(四) 协调处理公司套期保值重大事项；

(五) 行使董事会或股东大会授予的其他权利。

**第七条** 公司设立原材料套期保值业务小组，负责在权限范围内的具体业务操作和日常管理职能。成员单位包含各事业部、分子公司、战略与市场中心、财经中心等。

### 第三章 审批权限

**第八条** 公司从事期货和衍生品交易，应当编制可行性分析报告并提交董事会审议。

公司因交易频次和时效要求等原因难以对每次期货和衍生品交易履行审议程序和披露义务的，可以对未来 12 个月内期货和衍生品交易的范围、额度及期限等进行合理预计并审议。相关额度的使用期限不应超过 12 个月，期限内任一时点的金额(含使用前述交易的收益进行交易的相关金额)不应超过已审议额度。

期货和衍生品交易属于下列情形之一的，应当在董事会审议通过后提交股东大会审议：

(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，下同)占公司最近一期经审计净利润的 50%以上，且绝对金额超过 500 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 5000 万元人民币；

(三) 公司从事不以套期保值为目的的期货和衍生品交易。

#### 第四章 套期保值业务流程

**第九条** 套期保值领导小组根据行业特征和自身经营特点，制定相应套期保值业务流程及套期保值交易方案。

**第十条** 公司参与原材料期货和衍生品交易应当遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不从事以投机为目的的期货和衍生品交易。

##### 第十一条 交易规范

(一) 公司原材料套期保值业务小组根据领导小组批准的期货套期保值交易方案，进行具体执行。各事业部、分子公司必须严格执行套期保值原则。

(二) 事业部、分子公司负责人（或授权人）下达买卖期货的操作指令。

(三) 下达期货操作指令需提交战略与市场中心“期货保值备案申请审批流程”，经相关领导审批后备案。

(四) 受交易所持仓限制，事业部、分子公司期货套期保值数量超过限仓时，应在进入交割月前另外追加申请套期保值额度。

#### 第五章 风险管控

**第十二条** 套期保值业务小组同时配置操作及检查人员，并及时将交易结果反馈至事业部、分子公司指令人。

**第十三条** 审计部组织相关职能部门不定期对事业部、分子公司提供的基础数据部分或全部进行抽查，并将结果报送董事会审计委员会。当发生风险事项的情况时，应立即向套期保值领导小组报告。

**第十四条** 战略与市场中心和财经中心应当定期跟踪期货及衍生品公开市场价格或者公允价值的变化，及时评估已交易期货及衍生品的风险敞口变化情况，并向管理层和董事会报告期货及衍生品交易授权情况、交易头寸情况、盈亏状况等作为可行性报告提交董事会审议。当公司原材料套期保值实际使用额度达到年度预计金额的预警线时，业务小组应及时进行风险预警提示。

**第十五条** 为避免原材料价格大幅波动风险，公司将加强对行业的研究分析，实时关注市场环境变化，适时调整经营策略，控制风险。

## 第六章 信息披露

**第十六条** 公司开展套期保值业务时，应按照中国证监会及上海证券交易所的相关规定，及时披露公司开展套期保值业务的信息。

**第十七条** 当公司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

**第十八条** 本制度未尽事宜，依照国家有关法律、法规、规范性文件及《公司章程》的有关规定执行。本制度如与日后颁布的有关法律、法规、规范性文件的规定不一致的，按有关法律、法规、规范性文件的规定执行，并及时修订。

**第十九条** 本制度自公司董事会审议通过之日起实施，由公司董事会负责解释和修订。

宁波金田铜业（集团）股份有限公司

2024年4月