

上海永茂泰汽车科技股份有限公司

套期保值管理制度

(于 2020 年 4 月经公司第一届董事会 2020 年第一次临时会议审议通过)

第一章 总则

第一条 为了规范上海永茂泰汽车科技股份有限公司(以下简称公司)商品期货套期保值业务和期货交易流程,防范交易风险,确保套期保值和期货交易有序进行,根据公司章程及国家法律法规制定本管理制度。

第二条 公司进行期货交易的主要目的系通过商品期货合约对采购的原材料进行套期保值,避免与公司主营业务相关的原材料价格波动对公司生产经营造成不利影响,稳定原材料价格。本制度所称“套期保值”是指,为了避免原材料价格波动对生产经营的影响,根据有效合同或预测订单需求量,以及常备库存需要,在期货交易所通过买卖与铸造铝合金原料价格匹配度较高的商品期货品种进行的套期保值。

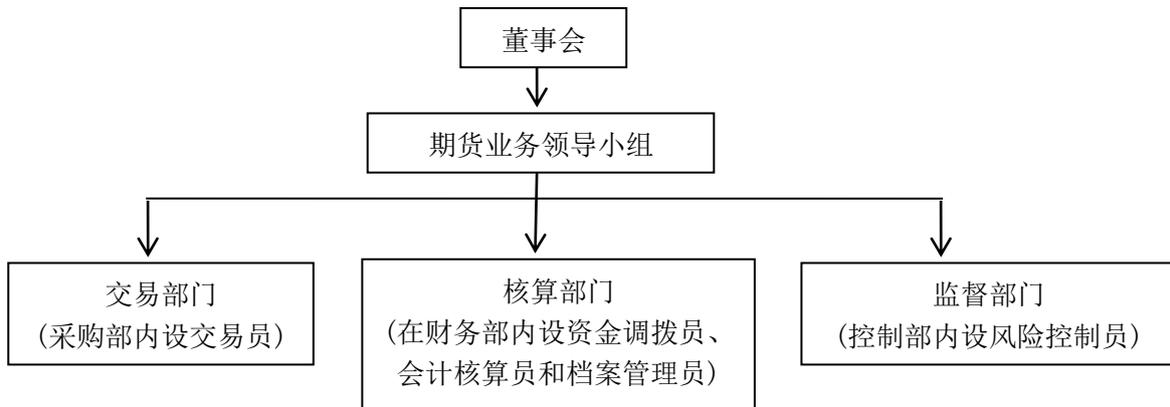
第三条 公司从事期货交易业务的资金来源于生产经营积累的自有资金,期货交易品种,只限于与公司生产经营相关的产品或原材料等,根据套期保值目的从事的期货交易品种持仓量原则上不超过现货需求量,因现货需求量变动而导致的富余仓单应根据市场情况适时进行平仓或移仓处理,期货交易初始保证金额度或最高持仓量根据公司授权审批制度,由相应的审批机构审批。

第四条 本制度适用于公司及下属子公司。

第五条 公司从事期货交易业务实行集体决策和风险控制制度,业务至少需两名以上的人员共同参与,不相容的岗位相互分离、互相制约。

第二章 组织机构与职责

第六条 公司董事会为从事期货交易的主要审批机构,在董事会领导下,公司设立“期货业务领导小组”从事商品期货交易日常决策,公司总经理任期货业务领导小组组长,公司财务负责人、采购负责人和控制部负责人为领导小组成员。期货交易组织机构如下:



第七条 公司按以上组织机构在采购部、财务部和控制部设置相应的岗位人员，具体如下：（一）交易员由公司采购部负责人兼任；（二）资金调拨员由财务部资金科长兼任；（三）会计核算员由主办会计兼任；（四）档案管理员由资金科出纳员兼任；（五）风险控制员由控制部负责人兼任。

第八条 董事会授权总经理主管期货交易业务，担任期货交易业务领导小组负责人，期货交易领导小组的职责为：

1. 安排小组成员制订相关制度，并报董事会审批。
2. 负责召开小组会议，制订年度套期保值计划，并提交决策机构审批；
3. 听取期货交易操作的工作报告，批准授权范围内的期货交易方案；
4. 负责交易风险的应急处理；
5. 负责对公司从事的期货业务进行监督管理和风险控制；
6. 行使董事会授予的其他职责。

第九条 交易部门为小组下设的日常办事机构，职责为：

1. 拟定、调整期货交易申请表、计划和操作方案，并报领导小组审批；
2. 执行具体品种的期货交易和结算；
3. 定期向领导小组汇报，必要时提交书面工作报告；
4. 其他日常联系和管理工作。

第十条 核算部门协助交易部门做好资金调拨和财务核算工作，职责为：

1. 根据公司的相关制度以及交易记录完成相应的资金收付款。
2. 严格管理相关的账户及账务处理工作；

3. 负责期货交易资料管理，包括套期保值计划、交易方案、交易原始日报表和结算资料等。

第十一条 监督部门的职责为负责监督和跟踪每笔交易与期货交易方案的一致性，如有异常需立即期货业务领导小组汇报。必要时每月向领导小组书面汇报风险控制工作。

第三章 授权审批制度

第十二条 与经纪公司订立的开户合同按公司签订合同的有关规定及程序审核后，由公司法定代表人或法定代表人授权的人员签署。

第十三条 公司从事期货交易的审批权限：期货交易初始保证金不超过 2,000 万元的交易，由公司期货业务领导小组决定；累计投入保证金超过 2,000 万元，但不超过 5,000 万元的由公司董事会审批；超过 5,000 万元的由公司股东大会审批。上述保证金是指按照上海期货交易所约定的最低初始交易保证金比例计算的保证金，遇法定节假日而临时追加的保证金或因实物交割而增加的资金不计入上述投资额度(保证金)范围。

第十四条 董事会授权期货业务领导小组执行的期货业务，应在审批权限范围及期货交易计划额度内进行，不得超范围操作。

第十五条 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。期货交易授权书由董事长签发。

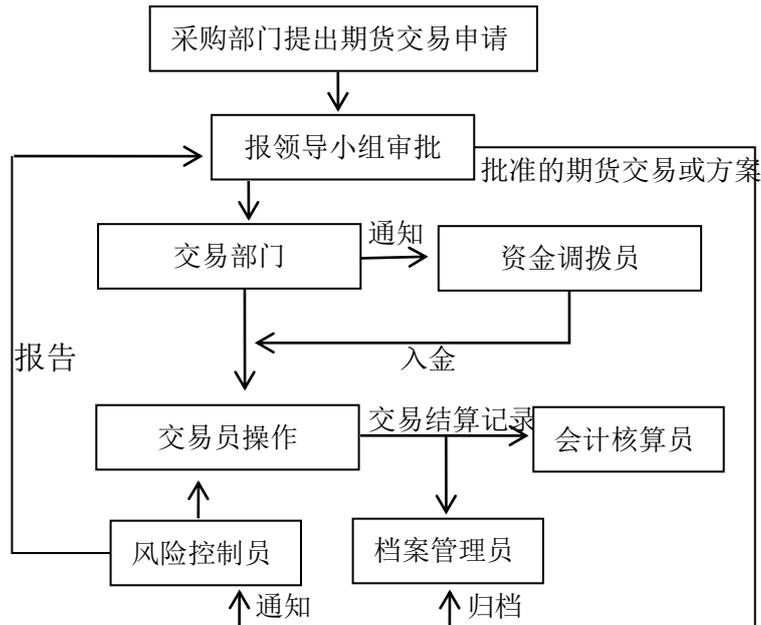
第十六条 被授权人应当在授权书载明的范围内，诚实并善意地行使权利，从事期货交易。如因任何原因造成被授权人变动的，被授权人的权限应当立即进行调整，并立即由授权人通知相关方。

第四章 期货交易的业务流程

第十七条 期货业务领导小组根据年度经营计划、现货和期货行情制定年度期货交易方案，并根据需要的保证金额度或持仓量报有权限的审批机构审批。采购部根据对所持有的有效合同(预测订单需求量)和中标业务以及常备库存的均价和数量，负责拟定期期货交易的具体操作方案，经采购部领导审批通过后，报公

司期货业务领导小组审批后执行。

第十八条 期货交易人员应根据期货交易方案，填写汇入或追加保证金的付款通知书，根据公司资金审批制度审批后执行。期货交易人员应根据交易方案下达交易指令，成交确认后，交易人员应填写交易明细表。期货交易人员应适时监控期货风险度，适时追加或划出保证金。



第十九条 会计核算员根据保值方案每日核查保值交易清单、核对自己账户盈亏，如有异常及时汇报领导小组组长。同时仔细核对经纪公司寄来的月对账单，并签字确认。

第二十条 风险管理应每日核查交易是否符合经审批的交易方案，若不符合需立即报告公司保值业务领导小组组长。

第二十一条 档案管理员需对每次的交易方案和业务相关的账本及资料进行及时归档。

第二十二条 根据实际情况，如需要进行实物交割了结套保头寸时，应提前对现货产品采购执行人，交易员及资金调拨员等相关各方沟通协调，以确保交割按时完成。

第二十三条 公司交易错单处理程序：

1. 当发生属经纪公司或交易所过错的错单时，由交易员通知经纪公司或交易所，并由经纪公司或交易所及时采取相应错单处理程序。再向经纪公司或交易所

追偿产生的直接损失。

2. 当发生属于交易员过错的错单时，需履行公司报告制度，再由交易员采取相应的指令，交易指令应能消除或尽可能减小错单对公司造成的损失。

第五章 风险管理

第二十四条 风险管理岗位不得与期货交易业务的其他岗位交叉，对期货业务监督部门负责；

第二十五条 公司风险管理员的主要职责包括：

1. 制定期货业务有关的风险管理政策及风险管理工作程序；
2. 监督相关人员执行风险管理政策和风险管理工作程序；
3. 审核期货交易方案是否与本制度规定一致；
4. 核查交易员的交易行为是否符合保值计划方案；
5. 对期货持仓头寸风险状况进行监控和评估，保证期货业务的正常进行；
6. 发现、报告并按程序处理风险事故；
7. 评估、防范和化解公司保值业务的法律风险。

第二十六条 公司期货业务领导小组按照不同月份实施情况来确定和控制当期的持仓量，期末持仓量不得超过授权范围。

第二十七条 公司按照下述规定进行风险测算：

(一) 资金风险：测算已占用的保证金数量，浮动盈亏，可用保证金数量及拟建头寸需要的保证金数量，公司对拟追加保证金的准备数量；

(二) 保证金头寸价格变动风险：根据公司期货业务方案测算已建头寸和需建头寸在价格变动后的保证金需求和盈亏风险。

第二十八条 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. 当市场价格波动较大或异常波动时，交易员应立即报告领导小组；
2. 当发生以下情况时，风险管理员应立即报告领导小组组长：
 - (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) 具体的期货交易方案不符合有关规定；
 - (3) 交易员的交易行为不符合经批准的期货交易方案；

(4) 公司头寸的风险状况影响到期货交易过程的正常进行；

(5) 期货业务出现或将出现有关的法律风险；

(二) 风险处理程序

1. 领导小组组长及时召开小组成员及其他有关人员参加的会议；分析讨论风险情况及应对措施；

2. 相关人员执行公司的风险处理决定。

第六章 档案管理

第二十九条 公司期货交易原始资料、结算资料、期货交易的开户文件、授权文件等档案等业务档案保存至少 10 年；

第七章 保密制度

第三十条 公司期货业务相关人员应遵守公司的保密制度；

第三十一条 公司期货业务的相关人员未经许可不得透漏公司的期货交易方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司交易有关的信息。

第八章 法律责任

第三十二条 本制度规定的期货交易按照规定的业务流程和审批流程操作的，交易损益由公司承担；未按规定流程和审批程序的交易行为，其导致的损失由相关责任人承担，在决策过程中明确提出反对意见的人员可以免责。

第三十三条 相关人员违反规定给公司造成损失的，应在合理的时间内将赔偿的金额支付至公司账户；多人违规导致公司损失的，通常由决策和授权者承担主要责任，交易和资金划拨者承担次要责任。

第九章 附则

第三十四条 本规定适用于公司及所属子公司，在董事会审议通过后施行，由董事会负责解释。

上海永茂泰汽车科技股份有限公司
二〇二〇年四月三日