

腾达建设集团股份有限公司

证券投资、期货和衍生品交易管理制度

第一章 总则

第一条 为规范腾达建设集团股份有限公司（以下简称“公司”）的证券投资、期货和衍生品交易业务，强化风险控制，防范交易风险，维护公司及全体股东利益，根据《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国证券法》《上海证券交易所股票上市规则》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第5号——交易与关联交易》等有关法律、法规、规范性文件及《公司章程》的有关规定，结合公司的实际情况，制定本制度。

第二条 本制度所述证券投资，是指在控制投资风险的前提下，以提高资金使用效率和收益最大化为目的，在证券市场投资有价证券的行为，包括但不限于新股配售或者申购、证券回购、股票及存托凭证投资、债券投资、收益凭证以及证券交易所认定的其他投资行为。

本制度所述期货交易，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；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 本制度适用于公司及合并报表范围内控股子公司的证券投资、期货和衍生品交易业务。控股子公司拟进行证券投资或期货、衍生品交易的，须报公司并根据本制度履行相应的审批程序，未经审批不得进行证券投资或期货、衍生品交易。

第二章 基本原则

第四条 公司进行证券投资、期货和衍生品交易业务须遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，应当防范投资风险、强化风险控制、合理评估效益，与公司实际业务相匹配，不能影响自身主营业务的正常运行。

第五条 公司开展期货和衍生品交易业务应当与具有相关业务经营资格的银行、证券、期货、基金类金融机构进行交易，不得与金融机构之外的其他组织或个人进行交易。

第六条 公司须以其自身名义或合并报表范围内子公司名义设立证券投资、期货和衍生品交易账户，不得使用他人账户进行证券投资或期货、衍生品交易业务。

第七条 公司须以自有资金从事证券投资和期货、衍生品交易，不得使用募集资金或不符合国家法律法规以及证券监督管理部门规定的资金直接或间接进行证券投资或期货、衍生品交易。公司应严格按照经审议批准的额度进行交易，控制资金规模，不得影响公司正常经营。

第三章 审批权限

第八条 公司进行证券投资、期货和衍生品交易，应严格按照法律、法规、规章、规范性文件、上海证券交易所业务规则、《公司章程》以及公司内部管理制度的规定履行审批程序。

董事会在审议证券投资、期货和衍生品交易等投资事项时，董事应当充分关注投资风险是否可控以及风险控制措施是否有效，投资规模是否影响公司正常经营，资金来源是否为自有资金，是否存在违反规定的投资等情形。

第九条 公司开展证券投资业务的审批权限如下：

（一）公司开展证券投资业务，应当经公司董事会审议通过方可进行；

（二）证券投资额度占公司最近一期经审计净资产 50%以上且金额超过 5000 万元人民币的，董事会审议通过后，还应当提交股东大会审议；

（三）公司因交易频次和时效要求等原因难以对每次证券交易履行审议程序和披露义务的，可以对未来 12 个月内证券交易的范围、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，期限内任一时点的交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过经审议的证券投资额度。

第十条 公司开展期货和衍生品交易业务的审批权限如下：

（一）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，独立董事应当发表专项意见。

（二）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：

1、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；

2、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；

3、公司从事不以套期保值为目的的期货和衍生品交易。

（三）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。

第十一条 公司与关联人之间进行上述交易的，还应当以投资额度作为计算标准，适用关联交易的相关规定。

第四章 管理及实施

第十二条 公司董事会和股东大会是公司证券投资、期货和衍生品交易的主要决策机构。公司管理层在董事会或股东大会授权范围内执行具体操作事宜。

根据董事会或股东大会的授权，公司董事或高管在授权范围内签署证券投资、期货和衍生品交易的相关协议、合同等文件。

第十三条 公司投资部负责证券投资、期货和衍生品交易的调研、洽谈、评估、执行具体操作事宜，必要时聘请外部专业机构提供投资咨询服务；并负责跟踪证券投资、期货和衍生品交易的进展及安全状况，出现异常情况时应及时向董事会报告。

投资部负责制订证券投资、期货和衍生品交易的应急处理预案，以及时应对交易过程中可能发生的重大突发事件，并针对各类衍生品或者不同交易对手设定适当的止损限额，明确止损处理业务流程，并严格执行止损规定。

投资部负责跟踪衍生品公开市场价格或者公允价值的变化，及时评估已交易衍生品的风险敞口变化情况。

第十四条 公司财务部负责证券投资、期货和衍生品交易所需资金的筹集和使用管理，负责对证券投资、期货和衍生品交易项目进行会计核算，负责对证券投资、

期货和衍生品交易项目保证金进行管理。

财务部应当指派专人负责证券投资、期货和衍生品交易账户的管理，包括开户、销户、使用登记等。

第十五条 公司董事会办公室根据证券监督管理部门的相关规定，负责审查证券投资、期货和衍生品交易业务决策程序的合法合规性并及时进行信息披露。

第十六条 独立董事有权对证券投资、期货和衍生品交易资金使用情况进行检查，有权聘请独立的外部审计机构对证券投资、期货和衍生品交易资金进行专项审计。

第十七条 公司监事会有权对证券投资、期货和衍生品交易资金 usage 情况进行监督。

第十八条 公司指定董事会审计委员会审查证券投资、期货和衍生品交易的必要性、可行性及风险控制情况，必要时可以聘请专业机构出具可行性分析报告。审计委员会应加强对证券投资、期货和衍生品交易相关风险控制政策和程序的评价与监督，及时识别相关内部控制缺陷并采取补救措施。

第十九条 董事会审计委员会应当督导内部审计部门至少每半年对证券投资、期货和衍生品交易业务进行一次检查，出具检查报告并提交董事会审计委员会。

第五章 内部控制

第二十条 公司应当建立健全证券投资、期货和衍生品交易内部控制制度，确保在人员、信息、账户、资金、会计核算上严格分离，确保证券投资、期货和衍生品交易业务的申请人、审核人、审批人、操作人、资金管理人相互独立。

第二十一条 严禁出借证券投资、期货和衍生品交易账户、使用其他投资账户、账外投资。严禁以个人名义从证券投资、期货和衍生品交易账户中调入调出资金。严禁从证券投资、期货和衍生品交易账户提取现金。

第二十二条 公司相关部门在开展投资业务前，应知悉相关法律、法规和规范性文件相关规定，不得进行违法违规交易。

第六章 信息披露

第二十三条 公司开展证券投资、期货和衍生品交易业务，应严格按照证监会及上交所的相关规定履行信息披露义务。

第二十四条 公司在调研、洽谈、评估证券投资、期货和衍生品交易项目时，内幕信息知情人对已获知的未公开的信息负有保密的义务，不得擅自以任何形式对

外披露及利用内幕信息进行内幕交易。

第二十五条 公司董事会应当持续跟踪证券投资、期货和衍生品交易的执行进展和投资安全状况，如出现投资发生较大损失等异常情况的，应当立即采取措施并按规定履行披露义务。

公司期货和衍生品交易已确认损益及浮动亏损金额每达到公司最近一年经审计的归属于上市公司股东净利润的 10%且绝对金额超过 1000 万元人民币的，应当及时披露。公司开展套期保值业务的，可以将套期工具与被套期项目价值变动加总后适用前述规定。

第七章 责任追究

第二十六条 由于工作失职或违反本制度规定，给公司带来严重影响或损失的，公司将根据实际情况给予相关责任人批评、警告、直至解除劳动合同等处分；情节严重的，将报告证券监管部门处理；涉嫌犯罪的，将移送司法机关处理。

第八章 附则

第二十七条 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。本制度与国家有关法律、法规、规范性文件及《公司章程》的规定不一致时，以国家有关法律、法规、规范性文件及《公司章程》的规定为准。

第二十八条 本制度所称“以上”包含本数；“超过”、“以下”不包含本数。

第二十九条 本制度自董事会审议通过之日起实施，修订时亦同。

第三十条 本制度由公司董事会负责解释。

腾达建设集团股份有限公司董事会

2023 年 10 月