

# 恒逸石化股份有限公司

## 商品衍生品交易管理制度

（经公司 2017 年第一次临时股东大会审议通过。）

### 第一章 总则

**第一条** 为规范恒逸石化股份有限公司（下称“公司”）商品衍生品交易行为，防范商品衍生品交易风险，根据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》及《公司章程》等有关规定，制定本制度。

**第二条** 本制度所称商品衍生品是指以商品为基础资产的场内场外交易、或者非交易的，实质为期货、期权、远期、互换等产品或上述产品的组合。既可采取实物交割，也可采取现金差价结算；既可采用保证金或担保、抵押进行杠杆交易，也可采用无担保、无抵押的信用交易。

**第三条** 公司应严格控制商品衍生品交易的种类及规模，并主要以套期保值为目的。

**第四条** 公司进行商品衍生品交易应控制资金规模，不得影响公司的正常生产经营。

**第五条** 公司进行商品衍生品交易必须以公司的名义并在公司的账户中进行，不得使用他人账户。

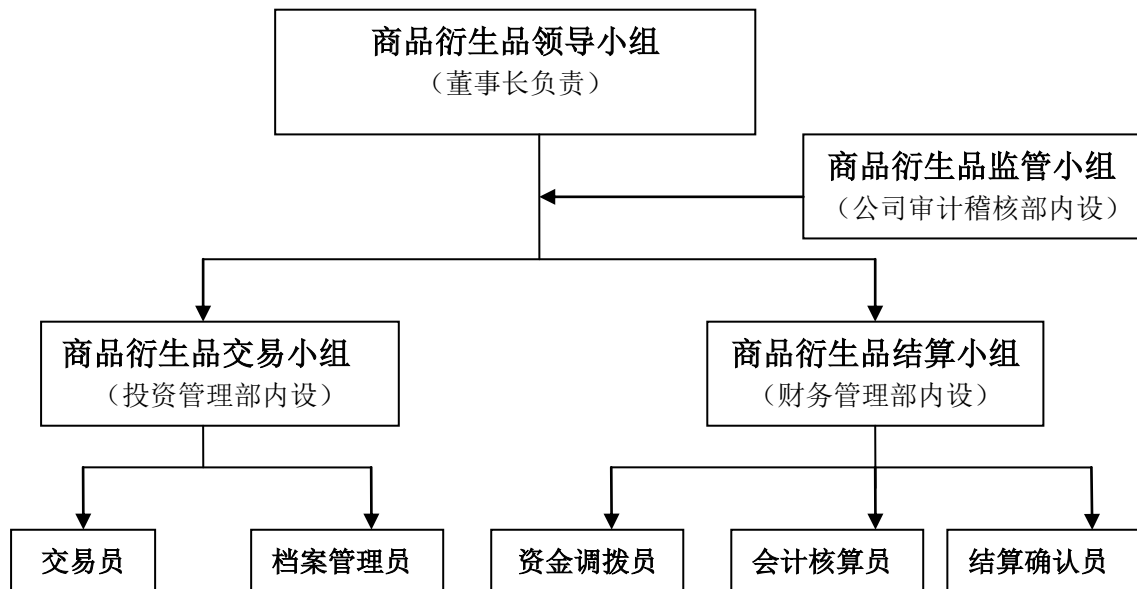
**第六条** 本制度同样适用于公司全资或控股子公司的衍生品交易。未经本公司同意，公司全资、控股子公司不得进行商品衍生品交易。

**第七条** 公司董事会授权董事长组建公司商品衍生品领导小组，主管公司商品衍生品交易业务。公司商品衍生品领导小组应根据实际需要，对商品衍生品交易业务管理制度进行审查和修订，确保本制度适应实际运作和内部控制的需要。

**第八条** 公司商品衍生品业务相关人员，应理解并严格执行本管理制度。

### 第二章 商品衍生品业务组织架构

**第九条** 公司商品衍生品业务体系包括：商品衍生品领导小组、商品衍生品交易小组、商品衍生品结算小组、商品衍生品监管小组。



**第十条** 公司商品衍生品领导小组由董事长、营销采购中心总经理、投资总监、财务总监及商品衍生品专业人士组成，其主要职责为：

- （一）建立健全公司商品衍生品业务相关制度，并组织贯彻实施；
- （二）组建公司商品衍生品业务交易小组、结算小组、监督小组；
- （三）制订公司商品衍生品业务工作思路；
- （四）审批公司商品衍生品业务方案，核准交易决策；
- （五）协调处理公司商品衍生品业务重大事项。

**第十一条** 公司商品衍生品交易小组在公司投资管理部内组建，其主要职责为：

- （一）会同其他小组制订公司商品衍生品业务方案；并根据公司商品衍生品领导小组的决定，组织落实商品衍生品业务方案；
- （二）负责公司商品衍生品业务的交易管理和交易风险控制；
- （三）根据市场变化情况，及时提出商品衍生品业务方案调整建议；
- （四）负责向公司商品衍生品领导小组报告公司商品衍生品业务交易情况；
- （五）接受公司商品衍生品监督小组的监督、检查；
- （六）完成公司商品衍生品领导小组布置的其他工作事项。

**第十二条** 公司商品衍生品结算小组在公司财务管理部内组建，其主要职责为：负责公司商品衍生品业务的资金管理、会计处理、交易确认和结算管理；并接受公司商品衍生品监督小组的监督、检查。

**第十三条** 公司商品衍生品监督小组在公司审计稽核部内组建，其主要职责为：

- （一）监督商品衍生品业务有关人员执行风险管理政策和风险管理工作程序；
- （二）定期审查商品衍生品交易小组的相关业务记录，核查交易员的交易行为是否符合商品衍生品业务交易方案；
- （三）对商品衍生品头寸的风险状况进行监控和评估，保证商品衍生品业务能够正常进行；
- （四）定期审查公司商品衍生品交易风险控制制度的设计与执行，及时发现商品衍生品业务管理中存在的内控缺陷，提出改进意见并报告。

**第十四条** 公司设立商品衍生品业务交易员、档案管理员、资金调拨员、会计核算员、结算兼交易确认员，并建立相应岗位责任：

- （一）交易员：负责商品衍生品交易的实际操作；负责与商品衍生品经纪公司或交易所的联络；负责商品衍生品市场信息的收集和分析，及时提出有关商品衍生品业务建议；负责编制交易报告；负责交易账户的管理。
- （二）档案管理员：负责公司商品衍生品业务形成的档案的收集、整理。
- （三）资金调拨员：负责公司商品衍生品业务的资金调拨、使用监督和资金账户的管理。
- （四）会计核算员：负责公司商品衍生品业务的会计处理。
- （五）结算确认员：负责公司商品衍生品业务交易情况的确认和交易后的结算；负责公司商品衍生品业务交易凭证的管理。

### **第三章 商品衍生品业务授权**

#### **第十五条 签约授权**

公司与商品衍生品经纪公司或交易所订立的开户合同，应按公司签订合同的有关规定及程序审核后，由商品衍生品领导小组批准，并由公司法定代表人或经法定代表人授权的人员签署。

#### **第十六条 交易授权**

公司对商品衍生品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、交易的程序和报告。商品衍生品交

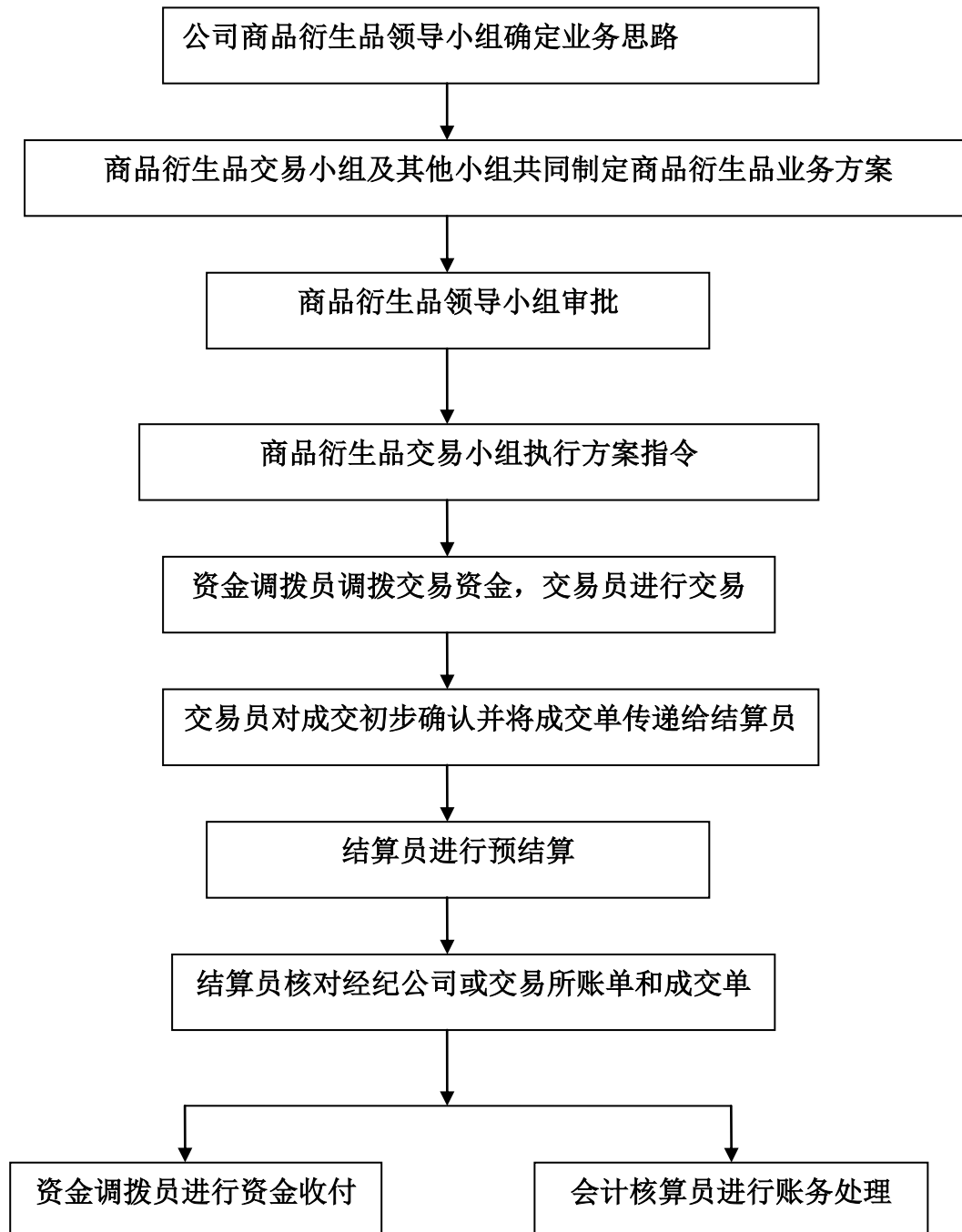
易授权书由公司商品衍生品领导小组组长签署。

**第十七条** 被授权人员只有在取得书面授权后方可进行授权范围内的操作。

**第十八条** 如因各种原因造成被授权人的变动，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，不再享有被授权的一切权利。

#### 第四章 商品衍生品业务流程

**第十九条** 公司的商品衍生品业务流程如下：



(一) 商品衍生品交易小组根据公司商品衍生品领导小组提出的商品衍生品

业务思路，制定商品衍生品业务方案，报经公司商品衍生品领导小组批准后方可执行。

（二）结算员根据公司的保证金情况，确定商品衍生品头寸限额，并通知交易员。

（三）交易员根据公司的商品衍生品业务方案选择合适的时机向商品衍生品经纪公司或交易所下达指令交易。

（四）交易员将与经纪公司或交易所初步确认的成交单传给结算员，结算员进行预结算处理。

（五）结算员将成交情况及结算情况信息传递给资金调拨员和会计核算员，资金调拨员依据公司相关制度进行相应的资金收付，会计核算员对开设在交易代理商的账户进行严格管理和账务处理，每个交易日后对持有头寸的价值进行分析，并对资金往来进行核对。

商品衍生品交易小组应按公司会计核算的相关规定及时将商品衍生品业务的相关汇总单证传递到公司商品衍生品结算小组。

## **第五章 风险管理及内控制度**

**第二十条** 公司开展的商品衍生品交易业务总体方案和额度需遵循公司章程的相关规定，即董事会决策权限为：法律法规允许的对股票、基金、商品及外汇等套保或投资资金总额累计不得超过公司最近一个会计年度经审计净资产的10%，其中商品业务保证金投资金额不得超过公司最近一个会计年度经审计净资产的8%，如超出则应提交股东大会审议通过总体方案和额度后方可进行。公司商品衍生品业务人员应在该限额下严格按照本制度第四章的有关规定进行业务操作。

### **第二十一条 实行公司商品衍生品业务日常报告制度**

（一）交易员每日向采购平台报告当天新建头寸情况、计划建仓及平仓头寸情况及最新市场信息等情况。

（二）结算员每日向商品衍生品结算小组及商品衍生品监督小组报告汇总持仓状况、结算盈亏状况及保证金使用状况等信息。

（三）商品衍生品结算小组应加强对超限额交易和保证金给付的监控，一旦发现未按事先计划进行的交易，应及时反馈和报告给公司商品衍生品领导小组及

商品衍生品监督小组。

## **第二十二条 实行公司商品衍生品业务定期报告制度**

公司建立商品衍生品监督小组每季度报告制度。商品衍生品监管小组应于每季终了十个工作日内，向公司商品衍生品领导小组提交相关报告，基本内容包括：公司商品衍生品业务的持仓规模、资金使用及效果等情况；公司商品衍生品业务相关人员对相关规章制度的执行情况；对公司商品衍生品业务内控的评价和建议等方面。对于发生重大亏损、浮亏超过止损限额、被强行平仓或发生法律纠纷等事项，在事项发生后三个工作日内向公司商品衍生品领导小组报告相关情况。

## **第二十三条 实行公司商品衍生品业务风险报告制度**

（一）当市场价格波动较大或发生异常波动的情况时，交易员应立即报告商品衍生品结算小组及商品衍生品监督小组；

（二）当市场价格发生异常波动影响到商品衍生品业务过程的正常进行时，交易员应立即报告公司商品衍生品领导小组。

## **第二十四条 风险处理程序：**

（一）公司商品衍生品领导小组组长及时召开公司商品衍生品领导小组和有关人员参加的会议，充分分析、讨论风险情况及应采取的对策；

（二）明确公司商品衍生品交易和风险限额，以及对越权行为的惩罚措施；

（三）明确相关人员执行公司风险处理的决定。

## **第二十五条 公司交易错单处理程序：**

（一）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措施，再向经纪公司或交易所追偿产生的直接损失；

（二）当发生属于公司交易员过错的错单时，须履行公司报告制度，再由交易员采取相应的指令，相应的交易指令要求能消除或尽可能减小错单对公司造成的损失。

## **第二十六条 实行商品衍生品业务档案管理制度**

商品衍生品业务的交易原始资料、结算资料等业务档案至少保存5年，商品衍生品业务开户文件、授权文件等档案应至少保存10年。

## **第二十七条 实行商品衍生品业务保密制度**

公司从事商品衍生品业务的相关人员不得擅自泄露本公司的商品衍生品业务方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司商品衍生品交易有关的信息。

## **第六章 违规责任**

**第二十八条** 本制度规定所涉及的交易指令、资金拨付、下单、结算、内控审计等各有关人员，严格按照规定程序操作的，交易风险由公司承担。超越权限进行的资金拨付、下单交易等行为的，由越权操作者对交易风险或者损失承担个人责任。

**第二十九条** 公司相关人员违反本制度进行资金拨付、下单交易以及泄露公司商品衍生品交易信息，由此给公司造成损失的，公司有权采取扣留工资奖金、向人民法院起诉等合法方式，向其追讨损失。其行为构成犯罪的，由公司向人民法院提起诉讼，追究刑事责任。

## **第七章 附则**

**第三十条** 本制度自公司股东大会通过之日起施行。

恒逸石化股份有限公司

2017年2月13日