

焦作万方铝业股份有限公司

期货保值业务管理办法

(董事会七届七次会议审议通过)

第一章 总则

第一条 为加强对焦作万方铝业股份有限公司(以下简称“公司”)期货保值业务的监督管理,有效防范期货风险,规范期货交易行为,结合本公司实际,特制定本管理办法。

第二条 本公司从事期货业务的原则是:坚持套期保值,不进行投机交易。

第三条 涉及期货保值业务的制度和重大决策必须经公司董事会通过后方可实施。

第二章 组织机构

第四条 公司成立期货工作领导小组,营销部和财务部负责办理具体业务,具体职责如下:

1. 期货工作领导小组指定专人根据期货工作领导小组决定下达交易指令,每天收市后对当天交易情况进行确认,完善相关确认及保证金手续。
2. 营销部负责市场分析及风险管理以及相关交易档案管理等工作。
3. 财务部负责期货业务的会计核算工作。

第五条 公司设置风险控制专职人员,负责风险控制监控工作。

第三章 授权制度

第六条 期货业务授权包括公司对外签发的交易授权、交易合同签约授权和交易资金调拨授权,分别授予相关人员。

1. 交易授权书内容包括授权交易员名单及签字样本、可从事交易的具体种类和交易金额。

2. 合同签约授权书内容包括有权对外签署交易合同的人员名单及签字样本、可签约交易种类和限额。

3. 交易资金调拨授权书内容包括公司有权进行期货资金调拨的人员名单及签字样本、可调拨资金限额。

第四章 套期保值计划

第七条 套期保值以规避现货交易风险为目的。交易仅限于境内与公司经营密切相关的期货及场外期权品种，包括铝、铜、镍、动力煤等。套期保值计划应列明拟保值的现货品种、计划数量，拟选择的期货品种计划数量和交易方向。

第八条 套期保值计划每年制定一次，制定的套期保值计划须报董事会批准，超出董事会权限的，还要报股东大会批准。

第五章 业务流程

第九条 期货交易主管部门根据套期保值计划制定具体保值方案，经期货领导小组批准后执行。具体保值方案中应包括期货保值品种及合约选择、保值数量的上下限、保值价格或确定保值价格的原则、结束交易的时间安排以及出现不利的市场形势时的应对方案等内容。

第十条 期货交易员通过电话下单或网上交易等方式执行交易指令，电话下单应有录音并保留录音至少 5 个工作日。

第十一条 期货交易员在交易成交后，交易员应于交易当天将与期货经纪公司确认过的交易单传送结算员。

第十二条 在实际成交与指令不符形成错单时，交易员应在接到通知后立即根据电话录音等交易记录进行核对，在确属于错单后应立即将错单平仓。

第十三条 期货实行每日结算制度。结算员每日将审核无误后的成交记录输入结算管理台帐，并对公司的出入资金、结算盈亏、浮动盈亏等项进行结算或预测，打印交易确认书、结算通知书、保证金状况表，每周和每月向单位主管领导报送当期期货交易头寸、结算、风险等报表。

第六章 报告制度

第十四条 期货交易人员应每日向公司相关领导及部门负责人报告开仓状况、持仓盈亏状况、平仓状况以及市场信息等基本内容。

第十五条 结算员应每日向公司相关领导及部门负责人报告结算盈亏状况、开口头寸风险状况、信用额度及保证金使用状况等。

第十六条 营销部应向公司期货业务主管领导每周书面报告开口头寸风险状况、信用保证金使用状况、累计结算盈亏、套期保值计划执行情况等，公司期货业务部主管领导应签阅报告并返还营销部存档。

第七章 风险管理

第十七条 公司建立并严格执行套期保值风险控制制度，利用事先、事中和事后的风险控制措施，预防、发现和化解市场风险、流动性风险、信用风险、操作风险和法律风险。

第十八条 公司应严格按照事先制订的套期保值计划规定，控制期货头寸建仓总量及持有时间。

第十九条 公司应建立有效的风险测算系统及相应的风险预警系统。公司设立专门的期货风险控制人员。风险控制人员应对可能出现的信用风险、市场风险、操作风险和法律风险等风险状况及时进行评估和预警。

风险控制人员应密切注意、跟踪、分析和预测市场走势，对可能出现的市场价格变化进行预测，进而对持有头寸可能出现的亏损做出预测；同时，在市场价格变化的情况下，要对继续按照既定保值方案进行保值操作可能带来的市场风险进行预测。

风险控制人员应严格监控期货业务流程中的每一个环节中各相关人员是否严格遵守相关的管理制度，及时发现问题，对可能出现的违反规定的行为所带来的风险做出预测。

第二十条 建立内部风险报告制度和风险处理程序。

公司期货风险控制人员在发现有违反公司风险控制管理制度的行为时，应要求相关部门采取纠正措施；出现如市场价格剧烈波动、代理机构出现信用或法律风险时，

风险控制人员应立即向公司期货工作领导小组报告，期货工作领导小组召开专门会议研究和拟订应对措施。

第八章 档案管理制度

第二十一条 期货业务的有关文件、单据必须存档，包括相关授权文件、套期保值计划、成交确认、资金往来、对帐单等。期货业务主管业务部门负责移交档案管理部门。

第九章 保密制度

第二十二条 期货相关人员应遵守公司的保密制度。

第二十三条 公司期货业务的有关信息如套期保值计划、期货头寸、资金、风险状况等均属公司商业秘密，相关人员必须对此严格保密，未经公司允许不得对外提供。

第十章 附 则

第二十四条 本办法实施前的有关规定与本办法不一致的，以本办法规定为准。

第二十五条 本办法经公司董事会会议审议通过后实施。

焦作万方铝业股份有限公司董事会

2017年3月6日