

江苏东方盛虹股份有限公司

衍生品交易管理制度

(2020年11月17日，经公司八届十九次董事会审议通过)

第一章 总则

第一条 为规范江苏东方盛虹股份有限公司（以下简称“公司”）的衍生品交易行为，建立完善有序的投资决策管理机制，有效防范投资风险，确保公司资产安全，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》、《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》等法律法规、规范性文件以及《公司章程》的有关规定，结合公司的实际情况，特制定本制度。

第二条 本制度所称的衍生品，是指远期、期货、掉期（互换）和期权等产品或者混合上述产品特征的金融工具。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 公司进行衍生品交易的资金来源应当为公司自有资金。公司应当合理安排、使用资金，致力发展公司主营业务，不得使用募集资金从事衍生品交易。

公司从事套期保值业务的期货品种应当仅限于与公司生产经营相关的产品或者所需的原材料。

第四条 公司从事衍生品交易，应当遵循合法、审慎、安全、有效的原则，建立健全内控制度，控制投资风险、注重投资效益。

公司应当分析投资的可行性与必要性，制定严格的决策程序、报告制度和监控措施，明确授权范围、操作要点与信息披露等具体要求，并根据公司的风险承受能力确定投资规模及期限。

第五条 公司全资子公司、控股子公司（以下简称“子公司”）发生的衍生品交易，视同公司行为，适用本制度的规定。未经公司同意，子公司不得进行衍生品交易。

第二章 衍生品交易的管理与监督

第六条 公司董事长为衍生品交易的第一责任人，董事长指定专门部门或专人牵头建立衍生品交易工作小组（以下简称“工作小组”），合理配备投资决策、业务操

作、风险控制等专业人员，负责衍生品交易业务的相关事宜。

第七条 工作小组应当制定具体操作规则或交易制度，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。工作小组应当控制现货与衍生品在种类、规模及时间上相匹配，并制定切实可行的应急处理预案，以及时应对交易过程中可能发生的重大突发事件。操作规则或交易制度报公司董事会备案。

第八条 公司财务部门应当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，并向董事长和董事会提交包括衍生品交易授权执行情况、衍生品交易头寸情况、风险评估结果、本期衍生品交易盈亏状况、止损限额执行情况等内容风险分析报告。

第九条 公司内审部门负责对衍生品交易项目的审计与监督，定期检查衍生品交易，合理的预计衍生品交易可能发生的收益和损失，并向董事会审计委员会报告。

第十条 公司监事会应对公司衍生品交易资金使用权情况进行监督。

第三章 衍生品交易的决策权限

第十一条 公司进行衍生品交易的决策权限如下：

1、工作小组应当就衍生品交易出具可行性分析报告并提交公司董事会，董事会审议通过并及时披露后方可执行。董事会审计委员会审查衍生品交易的必要性及风险控制情况，必要时可以聘请专业机构就衍生品交易出具可行性分析报告。独立董事应当发表专项意见。

2、从事超出董事会权限范围且不以套期保值为目的的衍生品交易，应在董事会审议通过、独立董事发表专项意见，并提交股东大会审议通过后方可执行。公司应当在发出股东大会通知前，自行或者聘请咨询机构对其拟从事的衍生品交易的必要性、可行性及衍生品风险管理措施出具专项分析报告并披露分析结论。

3、公司与关联人之间进行的衍生品关联交易应当提交股东大会审议。

第十二条 公司进行衍生品交易，如因交易频次和时效要求等原因难以对每次投资交易履行审议程序和披露义务的，可对上述事项的投资范围、投资额度及期限等进行合理预计，以额度金额为标准适用审议程序和信息披露义务的相关规定。相关额度

的使用期限不应超过12个月，期限内任一时点的衍生品交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过投资额度。

第十三条 董事会在审议衍生品交易等高风险投资等事项时，董事应当充分关注公司是否建立专门内部控制制度，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。

第四章 衍生品交易的报告与披露

第十四条 公司董事会秘书为衍生品交易信息披露义务的直接责任人，负责公司衍生品交易信息的对外公布，其他董事、监事、高级管理人员及相关知情人员，非经董事会书面授权，不得对外发布任何公司未公开的投资信息。

第十五条 衍生品交易实施过程中，发现投资方案有重大漏洞、项目投资实施的外部环境发生重大变化或受到不可抗力的影响、项目有实质性进展或实施过程中发生重大变化时，相关负责人或其他信息知情人应第一时间向公司董事长、董事会秘书报告。

第十六条 公司已交易衍生品的公允价值减值与用于风险对冲的资产（如有）价值变动加总，导致合计亏损或者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1000万人民币的，公司应当及时披露。

第五章 违规责任

第十七条 由于工作失职或违反相关法律法规、本制度及公司其他规定，给公司带来严重影响或损失的，公司将根据情况给予相关责任人相应的批评、警告、直至解除劳动合同等处分；情节严重的，将给予经济处罚；涉嫌违法或犯罪的，公司将按相关法律法规的规定移送司法机关进行处理。

第六章 附则

第十八条 本制度未尽事宜或与本制度生效后颁布、修改的相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件、深圳证券交易所其他规定或公司章程等相冲突的，按照相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件、深圳证券交易所其他规定和公司章程的规定执行。

第十九条 本制度由公司董事会负责制定、修改和解释，自公司董事会审议通过之日起生效。公司七届十九次董事会于2018年10月审议通过的《商品期货套期保值业务管理制度》、七届二十七次董事会于2019年4月审议通过的《外汇衍生品交易业务管理制度》同时废止。

江苏东方盛虹股份有限公司

2020 年 11 月