



洛阳栾川钼业集团股份有限公司

衍生品交易业务管理制度

(2026年7月31日第七届董事会第十三次临时会议审议通过)

证券代码：603993 SH

03993 HK

证券简称：洛阳钼业

第一章 总则

第一条 为规范洛阳栾川钼业集团股份有限公司(以下简称“公司”)及公司各全资和控股子公司(以下简称“各子公司”)金融衍生品交易行为,防范衍生品交易风险,根据《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国证券法》《期货交易管理条例》《上海证券交易所股票上市规则》《香港联合交易所有限公司证券上市规则》《中华人民共和国期货和衍生品法》《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》等法律、法规、规范性文件以及《洛阳栾川钼业集团股份有限公司章程》(以下简称“《公司章程》”)、《对外投资管理制度》等有关规定,结合公司的实际情况,特制定本管理制度。

第二条 本管理制度所称衍生品,是指场内场外交易、或者非交易的,实质为期货、期权、远期、互换等产品或者上述产品的组合。衍生品的基础资产包括商品、利率、汇率、货币等标的,也可包括上述基础资产的组合。

第三条 本管理制度适用于公司及各子公司的衍生品交易业务管理。未经公司相关审议机构审批同意,各子公司不得操作该业务。

第四条 公司主营商品贸易业务的子公司由于商品贸易的业务特性,其以对冲为目的的衍生品交易业务属于其日常经营业务的组成部分。为提升决策与执行效率,商品贸易业务的子公司的衍生品交易业务管理制度与操作流程经子公司董事会批准后,授权其自行决策并管理,公司资金管理部、财务管理部和内控内审部定期或不定期对其执行与管理情况进行检查,并向公司管理层报告。

第五条 公司开展衍生品交易业务行为除遵守国家相关法律、法规以及规范性文件的规定外,还应按照证券监督管理部门的相关规定履行有关决策程序和信息披露义务。

第二章 操作原则

第六条 公司和各子公司开展衍生品交易业务只允许与具有金融衍生品业务经营资格的金融机构、经纪公司等交易对手进行交易,不得与前述交易对手之外的其他组织和个人交易。

第七条 公司及各子公司应严格控制衍生品交易业务的种类及规模。

第八条 公司必须以自身名义或各子公司名义设立衍生品交易账户,不得使用他人账户或他人名义进行衍生品交易业务。

第九条 公司及子公司不得使用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衍生品交易业务。并且，公司及各子公司应严格按照公司内部机构审议批准的衍生品交易额度进行交易，控制资金规模，不得影响公司正常经营。

第三章 组织机构

第十条 公司衍生品交易业务组织机构及岗位设置应体现管理的垂直性、业务的相互制约性以及职责的分离性。

公司董事会投资委员会或其授权管理层人士负责审核公司衍生品交易业务，为公司衍生品交易业务的决策机构。资金管理部是公司衍生品交易业务管理机构，内部应建立前台（交易执行）与中台（风险监控）严格分离的机制，交易人员不得兼任风控岗人员。财务管理部是公司衍生品交易业务财务管理机构。董事会办公室是公司衍生品交易业务对外披露机构。内控内审部是公司衍生品交易业务监督机构。

第四章 决策程序

第十一条 公司衍生品交易业务实行分级审批与限额授权制度。公司投资委员会可在董事会授权交易额度及有效期内，授权公司管理层人士审议批准衍生品交易业务事项。超过上述管理层授权限额、或超过投资委员会权限范围、或拟开展新种类衍生品业务的，必须呈报公司董事会审议通过。达到《公司章程》及上市规则规定的股东会审议标准的，应提交股东会审议通过后方可执行。

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会审议：

（一）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；

（二）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；

（三）公司从事不以套期保值为目的的衍生品交易。

构成关联交易的衍生品交易业务应当履行关联交易表决程序。

第十二条 对属于投资委员会或其授权管理层人士权限范围内的衍生品交易业务，由资金管理部根据管理职责拟订衍生品交易业务可行性分析报告，经公司投资委员会或其授权管理层人士审核同意后方可执行。

第五章 交易授权

第十三条 公司及各子公司在与经纪行、期货公司、金融机构等衍生品交易业务结算机构或交易对手开立账户、开展交易前，应按公司内部合同管理办法的有关规定及程序，对结算机构或交易对手进行资信审查并由公司被授权人员签署。

第十四条 公司及各子公司对衍生品交易业务操作实行授权管理。决策人员应与交易执行人员分离。交易授权书应列明有权交易的人员名单、交易对手方、可开展交易的品种与数量、授权有效期等。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。衍生品交易业务授权书由公司投资委员会或其授权管理层人士授权相关人员签署。

第十五条 如因各种原因造成被授权人的变动，在经公司投资委员会或其授权管理层审批后，应立即由资金管理部通知业务相关各方。自公司审核通过之时起，被授权人不再享有被授权的一切权利。

第六章 业务流程

第十六条 公司年度衍生品交易业务计划和具体方案由资金管理部进行起草，报公司投资委员会或其授权管理层审批，通过后实施。

第十七条 公司年度衍生品交易业务计划应以公司生产与贸易等实际经营需求为依据，严格遵循套期保值原则，以对冲风险为主要目的，列明衍生品交易的类型、品种、金额，交易场所等。公司及各子公司衍生品交易量不得超过同期实际业务量或风险敞口规模。

第十八条 资金管理部应严格按照公司年度衍生品交易业务计划进行交易，如因市场变化需要变更交易计划的，应提前五个工作日拟订变更计划，上报公司投资委员会或其授权管理层人士批准，超出相关管理层人士授权范围的交易计划，应提报投资委员会批准。

第十九条 衍生品交易业务操作流程：

（一） 资金管理部负责对衍生品交易业务的具体操作，对标的资产的价格变动趋势进行研究与判断，通过对拟进行衍生工具套期保值的基础资产进行分析，提出开展或中止金融衍生品业务的建议，形成操作方案后，由公司相关管理层人士审核并评估风险；

（二） 资金管理部负责公司衍生品交易业务的压力测试，安排调度交易保证金和交割资金；

（三） 资金管理部负责根据金融机构报价完成衍生品交易业务审批单并履行审批程序，审批单内容至少应包括交易金额、交易期限、交易对手报价以及业务品种等内容，由公司相关管理层人士在授权范围内进行审批；

（四） 资金管理部根据经过审批后的交易安排，向金融机构提交衍生品业务申请，金融机构根据公司申请，确定衍生品交易业务的最终交易价格，经公司相关管理层人士审核同意后，双方签署相关合约；

（五） 资金管理部应对每笔衍生品业务交易进行登记，检查交易记录，及时跟踪交易变动状态，妥善安排交割资金；

（六） 资金管理部应每月出具衍生品交易业务报表，并报送公司相关管理层人士、财务管理部及内控内审部，报表内容至少应包括交易时间、基础资产类型、金额、期限、盈亏情况等；

（七） 资金管理部根据本管理制度规定的内部风险报告和信息披露要求，及时将有关情况告知董事会办公室及董事会秘书。

第七章 风险管理

第二十条 公司应当建立有效的风险管理制度；利用事前、事中及事后的风险控制措施，预防、发现和化解信用风险、市场风险、操作风险和法律风险。

第二十一条 财务管理部、资金管理部分别从风险识别、风险衡量、风险解决，执行衍生品交易业务风险管理和控制。

第二十二条 公司应当建立有效的风险测算系统和预警系统，包括保证金和头寸两个方面：

（一） 流动性风险：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、公司对可能追加的保证金的准备数量；

（二） 衍生品头寸价格变动风险：根据市场价格变化，做出平仓决策。

第二十三条 资金管理部应对拟交易衍生品业务特点，针对不同交易对手，在年度衍生品交易业务计划和具体方案设定适当的止盈、止损限额，交易团队在交易过程中严格执行。

第二十四条 对于不属于交易所场内集中交收清算的衍生品交易业务，资金管理部应密切关注各交易对手信用风险的变动情况，定期对交易对手的信用状况、履约能力进行跟踪评估，并相应调整交易对手履约担保品的头寸。

第二十五条 实行衍生品交易业务日常报告制度：资金管理部应当对其负责的衍生品交易业务范围建立和更新所有头寸情况、计划建仓、平仓的头寸情况、结算盈亏状况及保证金使用状况、最新市场信息状况等信息，并由资金管理部负责汇总，出具整体报告。

第二十六条 公司严格按照规定安排和使用衍生品交易业务的交易团队，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高交易团队相关人员的综合素质。

第二十七条 公司设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。

第二十八条 当衍生品交易业务遇突发事件、价格出现异常波动、境内外代理机构和交易对手出现信用、法律风险时，资金管理部应及时向公司相关管理层人士和投资委员会汇报。

第二十九条 涉及司法诉讼时，应该评估对正在进行的衍生品交易及对信用状况产生的负面影响，资金管理部应会同公司法律合规部及顾问采取相应措施防范法律风险。

第八章 信息披露

第三十条 公司应根据《上海证券交易所股票上市规则》《香港联合交易所有限公司证券上市规则》等法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的有关规定，对衍生品交易业务信息进行分析 and 判断，如需要公司履行信息披露义务的，按有关规定予以公开披露。

第三十一条 公司已交易尚在存续期的衍生品交易业务对公司净利润的影响，或其公允价值变动与用于风险对冲的资产（如有）价值变动加总，导致合计盈利（或浮动盈利）或亏损（或浮动亏损）金额达到公司最近一期经审计归属母公司净利润的5%时，或存在其他公司认为可能对公司上市证券价格产生重大影

响的信息时，应及时提交投资委员会审阅，并提交董事会办公室判断是否构成内幕交易信息、是否需要及时披露。

第九章 档案管理

第三十二条 公司相关部门对衍生品交易计划和方案、交易原始资料、结算资料及交割资料等业务档案至少保存5年，衍生品交易开户文件、授权文件等档案应至少保存10年。

第十章 保密制度

第三十三条 公司从事衍生品交易业务的相关人员应遵守公司的保密制度，未经允许不得泄露本公司的衍生品交易方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司衍生品交易有关的信息。

第十一章 附则

第三十四条 本管理制度未尽事宜，依照国家有关法律、法规、规范性文件以及本公司章程的有关规定执行。与有关法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的有关规定不一致的，以有关法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的规定为准。

第三十五条 本管理制度由公司投资委员会负责解释。

第三十六条 本管理制度自公司董事会审议通过后生效。

第三十七条 本制度发布后，《套期保值管理制度》及原《衍生品交易业务管理办法》自动失效。