

深圳市中金岭南有色金属股份有限公司

期货套期保值管理制度

为加强和规范深圳市中金岭南有色金属股份有限公司生产与贸易型企业的期货套期保值业务管理，充分利用期货市场套期保值的功能实现公司的经营目标，防范和化解公司经营风险，根据国家等有关法律法规，结合公司的具体情况，特制订本管理制度。

第一章 总 则

第一条 公司在期货市场上只能从事与所生产和经营的产品、所采购物资的套期保值业务，不得进行投机交易。

第二条 公司在境内外从事期货业务的目的是建立价格风险管理机制，为公司持续稳定发展创造条件。

公司期货套期保值业务应严格执行国家有关的法律法规。

第三条 公司董事局是期货套期保值业务的最高决策机构，负责制定和修订期货套期保值管理制度、审议批准年度套期保值计划。

公司经营管理层根据董事局审议通过的期货套期保值制度拟定期货套期保值管理制度实施细则，制定和完善期货套期保值的业务流程，对所有境内外期货套期保值业务实行统一的计划、管控和监督。

第二章 授权制度

第四条 公司应按照期货套期保值业务的需要合理配备高级管理人员、

风险管理人员及期货交易、结算和合规检查等从业人员，并加强职业道德教育及专业技能培训，提高期货套期业务团队综合素质。

公司期货套期保值业务实行授权管理，期货套期保值业务授权包括交易授权、交易合同签约授权、交易资金调拨授权及其他授权。保持交易授权、交易合同签约授权和交易资金调拨授权相互独立，交易权必须与签约权、资金调拨权分离。

第五条 交易授权书须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；交易合同签约授权书须列明有权签约的人员名单、可签约交易种类和限额；交易资金调拨授权书须列明有权进行资金调拨的人员名单和资金限额。

第六条 公司期货套期保值业务的各项授权书由公司法定代表人或经法定代表人书面授权的人员签署。公司与境内外期货经纪或代理机构订立的开户合同应按公司合同管理制度规定的程序审核后报公司总裁批准，并由公司法定代表人书面授权的人员签署。

法定代表人签约及授权的时限为其任期时间。经法定代表人书面授权的人员签约及授权的时限视法定代表人书面授权中的规定而确定。

第七条 被授权人只有在取得书面授权后方可进行授权范围内的操作。

第三章 期货套期保值计划

第八条 公司期货套期保值业务必须制定计划，公司期货套期保值计划包括公司生产经营和贸易的套期保值。

第九条 公司应收集和研究与期货套期保值产品相关的国家宏观

经济政策、行（产）业政策及进出口政策及调整，分析国内外市场形势及产品供需动态变化等方面的信息，为董事局审议年度期货套期保值计划提供决策支持。

第十条 公司制定的期货套期保值计划须以生产与贸易型企业的自产、加工、贸易、进出口等实际经营需求为依据，以规避价格风险为目的；套期保值计划应列明需要在期货市场上与所从事生产和经营的产品和所采购的物资相匹配的套期保值的类型、比例、品种、计划数量，拟选择的期货品种、计划数量。

第十一条 公司年度期货套期保值计划须经公司董事局审议批准并授权公司经营管理层后方可实施。

第十二条 公司经营管理层以公司董事局审议批准的期货套期保值计划为依据，在研判市场环境、公司生产和经营情况，并综合考虑期货套期保值业务的交易、信用/保证金、外汇风险敞口等风险因素，确定实施期货套期保值计划的策略。

第四章 风险管理制度

第十三条 公司须建立事前、事中及事后的期货套期保值风险控制措施，以预防、发现和化解期货套期保值业务的信用风险、市场风险、操作风险和法律风险。

第十四条 公司设置期货套期保值专职风险管理人员，不与期货套期保值业务其他岗位交叉，直接对公司总裁负责。

第十五条 期货套期保值风险管理人员的主要职责包括：

(一)根据 期货套期保值业务有关的风险管理政策及风险管理工作程序，对期货套期保值业务进行风险监督；

(二) 管理经纪或代理机构授予的信用额度；

(三) 对期货套期保值头寸的风险状况进行监控和评估，及时发现、报告风险事故。

(四) 对期货经纪或代理机构、结算机构进行资信审查，并综合期货经纪或代理机构的资信及授予信用额度等情况，合理确定其每年的交易限额。

第十六条 公司设置合规检查人员，并独立于期货套期保值业务相关的部门或岗位，直接对公司总裁负责。

第十七条 合规检查人员的主要职责包括：

(一) 监督公司执行境内外有关期货的法律、法规及政策；

(二) 监督公司执行董事局审议通过的期货套期保值管理制度；

(三) 拟定年度合规检查计划并实施，报告期货套期保值管理制度执行效果及存在的问题和提出改进意见。

第十八条 设立符合期货套期保值要求的交易、通讯及信息服务设施，并具备稳定可靠的维护能力，保证交易系统正常运行。

第十九条 涉及司法诉讼时，应该评估对正在进行的期货交易及对信用状况产生的负面影响，并采取相应措施防范法律风险。

第五章 外汇管理制度

第二十条 公司境外期货套期保值业务所涉及外汇敞口的申请与登记

及与外汇业务相关业务登记凭证与变更等手续执行国家外汇管理规定。

第二十一条 公司依据境外期货套期保值业务需要和国家外汇管理规定, 开立境外期货业务项下境内专用外汇账户和境外期货业务项下境外保证金账户, 严格执行国家相关法律法规的收支范围, 专户专用。

第二十二条 公司应当按照国家有关外汇管理规定, 报送境外期货业务项下相关信息。

第六章 监督管理制度

第二十三条 根据中国证监会的规定, 向中国证监会派出机构报备境外期货业务及相关情况。

第二十四条 公司期货套期保值业务服从中国证监会或中国证监会授权的监管机构的年度检查, 确认从事境外期货业务的资格, 接受监管机构对期货套期保值业务监管。

第七章 报告制度

第二十五条 公司经营管理层根据《深圳证券交易所主板上市公司规范运作指引》的要求, 向公司董事局报告本期公司期货套期保值执行情况及下一期计划。报告内容包括: 公司的风险管理策略、投资衍生品的种类、交易合约金额、至报告期末公司的期货平仓、持仓与套期保值保值计划执行情况。

第八章 保密制度

第二十六条 公司从事期货套期保值业务人员须遵守公司的保密制度,

并与公司签订保密协议书。

第二十七条 公司从事期货套期保值业务人员未经允许不得泄露本公司的期货套期保值计划、交易情况、结算情况、资金状况等。

第二十八条 期货套期保值业务的计算机系统应实行分级授权管理制度。如计算机管理人员因岗位变动或调离，应及时更改计算机密码。

第九章 附 则

第二十九条 本制度适用于本公司及所属全资、控股子公司生产与贸易型业务。

第三十条 本制度自公司董事局审议通过之日起施行。

深圳市中金岭南有色金属股份有限公司

二〇一六年八月十二日