



盛屯矿业集团股份有限公司
CHENGTUN MINING GROUP, LTD

商品衍生品交易业务管理制度

第一章总则

第一条 为进一步规范盛屯矿业集团股份有限公司（以下简称“公司”）商品衍生品交易业务，防范商品价格波动风险，保证商品价格风险的可控性，根据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《上市公司信息披露管理办法》等国家相关法律法规及《公司章程》、公司《财务管理实施细则》等有关规定，结合公司实际经营情况，特制定本制度。

第二条 本制度所称商品衍生品交易业务包括期货、期权、掉期等产品或上述产品的组合；衍生品的基础资产主要包括上海期货交易所、大连商品期货交易所、郑州商品期货交易所、上海黄金交易所、无锡不锈钢电子交易中心、伦敦金属交易所、纽约商品交易所、伦敦金银市场协会、香港交易所等中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的产品；公司交易品种主要为与公司产业布局相关的有色金属和贵金属品种；交易本金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、无抵押的授信额度交易；既可采取实物交割，也可采取现金价差结算。

第三条 本制度适用于公司及其下属全资子公司、分公司，控股子公司参照执行。

第二章操作原则

第四条 公司商品衍生品交易行为主要以正常经营业务为基础，以具体经营业务为依托，以套期保值为主要手段，以规避和防范商品价格风险为主要目的。

第五条 公司进行商品衍生品业务只允许与具有商品衍生品业务经营资格的金融机构进行交易，不得与前述金融机构之外的其他组织或个人进行交易。公司境外子公司还应当依法参照当地交易法规和习惯执行。未经公司同意不得开展商

品衍生品业务。

第六条 公司应当以其自身名义设立商品衍生品业务交易账户，不得使用他人账户进行商品衍生品交易业务。

第七条 公司应当具有与商品衍生品业务保证金相匹配的自有资金，不得使用募集资金直接或间接进行商品衍生品交易业务，且严格按照审议批准的商品衍生品业务，控制资金规模，不得影响公司正常经营。

第八条 公司进行商品衍生品交易业务必须注重风险防范，坚持风险控制与具体操作相互分离的原则。

第三章审批权限

第九条 公司开展商品衍生品业务须办理相关审批程序后方可行。

第十条 公司开展商品衍生品业务的审批权限如下：

- (一) 公司商品衍生品业务的开展和授权，归属商品衍生品业务领导小组。
- (二) 各被授权人在授权范围内决策具体策略和操作。

第十一条 公司董事会授权公司总裁或其授权人批准商品衍生品业务方案及签署商品衍生品业务相关合同。公司董事会授权总裁或其授权人负责商品衍生品业务的运作和管理，并在授权范围内负责签署相关协议及文件。

第四章管理组织设置与职责

第十二条 总裁负责组织建立商品衍生品业务领导小组，由该领导小组行使商品衍生品业务管理职责，总裁或其授权人负责签署相关协议及文件；小组成员包括：总裁、副总裁、交易部门负责人、财务部负责人、业务部门负责人、内控部门负责人、董事会秘书及与商品衍生品业务有关的其他人员。

第十三条 商品衍生品业务领导小组的职责为：

- (一) 负责对公司从事商品衍生品业务进行监督管理。
- (二) 负责召开商品衍生品业务领导小组会议，制订年度商品衍生品业务计划。
- (三) 负责审定公司商品衍生品业务管理工作的各项具体规章制度，决定工作原则和方针。
- (四) 负责商品衍生品交易业务风险的应急处理。
- (五) 负责向公司提交年度报告和下年度工作计划。

第十四条 各相关部门的职责及责任人为：

- (一) 交易部门是商品衍生品业务经办部门，负责商品衍生品业务的可行性分析及计划制订、业务操作及使用监督，交易部门负责人为责任人。
- (二) 内控部门负责对商品衍生品业务日常工作进行定期稽核或专项稽核，并就发现的问题向领导小组提供相关报告，内控部门负责人为责任人。
- (三) 业务部门是商品衍生品业务的配合及申请部门，负责提供与未来生产、采购、销售相关的基础业务信息和资料。分管采购、销售相关业务的总裁或其授权人负责结合采购和销售定价策略的测算情况，向交易部门提出商品衍生品的操作申请，公司业务部门负责人为相关基础资料提供的责任人。
- (四) 财务部负责商品衍生品业务的资金调拨、使用及资金账户的管理，财务总监为负责人。
- (五) 董事会秘书办公室负责根据中国证监会、上海证券交易所的要求及时进行信息披露，董事会秘书为责任人。业务过程中，触发到《公司法》、《证券法》、中国证监会、上海证券交易所法律法规等要求的事项，业务负责人需及时报送董事会秘书办公室。

第五章内部操作流程

第十五条 公司交易部门以稳健为原则，制订商品衍生品的交易方案，经总裁或其授权人审核后方可实施。交易部门负责管理各经营单位商品衍生品交易的需求、额度，报商品衍生品业务领导小组审核，各经营单位在经审核过后的权限内操作。内控部门对经营单位商品衍生品业务进行监督、稽核等工作。

第十六条 公司商品衍生品业务的内部操作流程：

（一）各经营单位提出商品衍生品交易业务的申请并经有权审批人审批后，提交至授权操作部门。

（二）各级授权操作部门负责商品衍生品交易业务的具体操作，通过市场调查、对商品走势进行研究和判断，对拟进行交易的商品的价格水平、库存情况、交割期限等进行分析，提出商品衍生品交易方案。

（三）各级授权操作部门根据交易计划，依据商品衍生品市场的每日行情以及各金融机构报价信息，进行比价，在自身的权限范围内，提交有权审批人审批后确定交易。

（四）公司交易部门应当要求合作金融机构定期向公司提交交易清单，并就收取的费用开具发票。

（五）公司交易部门应当对每笔商品衍生品交易进行登记，检查交易记录，及时跟踪交易变动状态，妥善安排交割资金，严格控制，杜绝交割违约风险的发生。

（六）公司内控部门应当定期或不定期对商品衍生品业务的实际操作情况，资金使用情况及盈亏情况进行审查。

第六章信息隔离及措施

第十七条 参与公司商品衍生品业务的所有人员及合作的金融机构须遵守公司的保密制度，未经允许不得泄露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业务有关的信息。

第十八条 公司商品衍生品业务操作环节相互独立，相关人员相互独立，并由公司内控部门负责监督。

第七章内部风险报告制度及风险处理程序

第十九条 在商品衍生品业务操作过程中，公司交易部门应按照公司与金融机构签署的协议中约定的交易金额、价格，及时与金融机构进行结算。

第二十条 当商品市场发生剧烈波动时，交易部门应及时进行分析，并将有关信息及时上报商品衍生品业务领导小组及相关人员，由领导小组决策后下达操作指令。

第二十一条 交易部门应保证按照商品衍生品业务领导小组要求实施具体操作并随时跟踪业务进展情况。

第二十二条 内控部门应认真履行监督职能，发现违规情况立即向总裁报告，并同时向董事会报告；公司总裁及领导小组成员应立即商讨应对措施，提出解决方案。

第八章信息披露

第二十三条 公司应当按照相关法律、法规、规范性文件和《公司章程》等的有关规定，及时披露商品衍生品业务信息。

第九章附则

第二十四条 本制度未尽事宜，按国家有关法律法规和《公司章程》的规定执行。

第二十五条 本制度由公司董事会负责解释。

第二十六条 本制度由董事会制订并修改，经董事会审议通过之日起生效。