

# 匹凸匹金融信息服务（上海）股份有限公司

## 期货套期保值业务管理制度

（经公司第七届董事会第三十一次会议审议通过）

### 第一章 总则

第一条 为规范匹凸匹金融信息服务（上海）股份有限公司（以下简称“公司”）下属子公司——上海事聚贸易有限公司（以下简称“事聚贸易”）期货套期保值业务，有效防范和化解风险，根据《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称“《上市规则》”）、《匹凸匹金融信息服务（上海）股份有限公司章程》（以下简称“《公司章程》”）等相关规定，特制定本管理制度。

第二条 事聚贸易期货套期保值业务只限于在期货交易所交易的商品期货品种，目的是充分利用期货市场的套期保值功能，减少事聚贸易因产品价格波动造成的损失。事聚贸易在期货市场从事套期保值交易的品种原则上与其所经营的商品品种相符。

第三条 事聚贸易全年期货套期保值总保证金不超过董事会审议批准的额度，如所需保证金超过上述额度，则须事聚贸易董事长上报公司董事会，由公司董事会根据公司章程及有关内控制度的规定进行审批后，依据本管理制度进行操作。

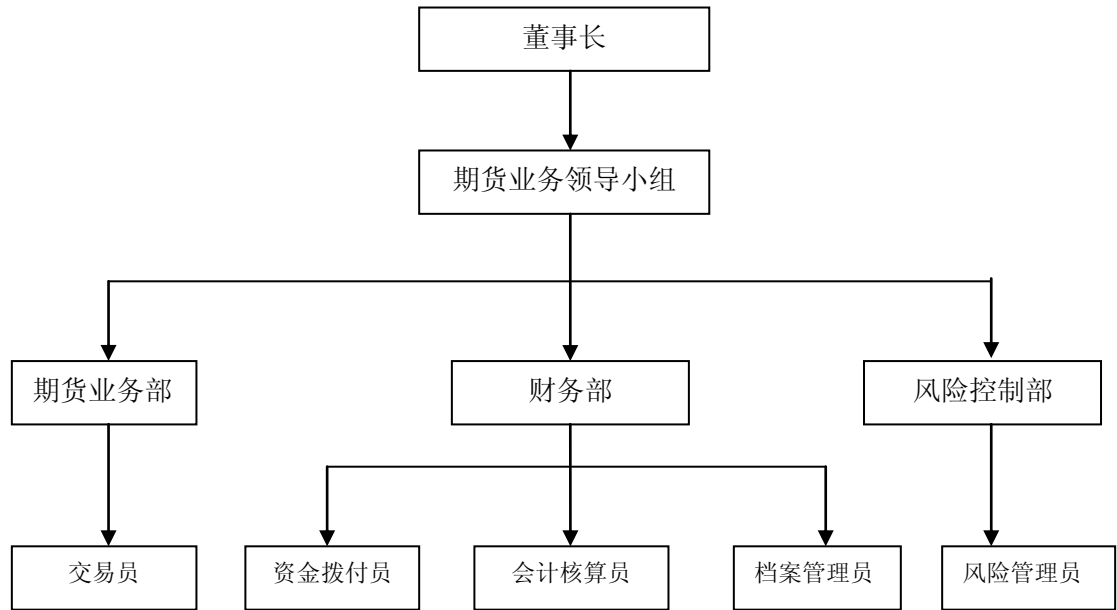
第四条 公司根据实际需要对管理制度进行审查和修订，确保制度能够适应实际运作和新的风险控制需要。

第五条 本管理制度应传达到每位相关人员，相关人员须理解并严格贯彻执行本管理制度。

### 第二章 组织机构

第六条 事聚贸易董事长负责期货套期保值的整体决策及实施，并组织建立事聚贸易期货业务领导小组，其成员：总经理、副总经理、财务负责人、市场负责人、风控负责人以及与套期保值业务有关的其他管理人员，事聚贸易总经理或指定的相关责任人员为期货业务领导小组组长。

事聚贸易期货套期保值业务组织机构图：



第七条 事聚贸易期货业务领导小组的职责为：

- 1、制订、调整套期保值计划、交易方案，并报事聚贸易董事长审批。
- 2、向事聚贸易董事长汇报并提交书面工作报告。
- 3、其他日常联系和管理工作。

第八条 期货业务部具体职责为：

- 1、会同事聚贸易市场部、财务部等部门组织制订期货套期保值业务方案；
- 2、负责事聚贸易期货套期保值业务的交易管理和交易风险控制；
- 3、根据事聚贸易期货业务领导小组的决定，组织落实期货套期保值业务 方案，执行具体的套期保值交易；
- 4、负责期货市场、现货市场信息的收集和趋势分析，及时提出套期保值业务和现货业务建议；
- 5、负责事聚贸易期货套期保值业务和现货业务事项的日常衔接；
- 6、负责向事聚贸易期货业务领导小组以及总经理报告期货套期保值业务交易情况；
- 7、根据期货市场变化情况，及时提出事聚贸易期货套期保值业务方案调整建议；
- 8、接受公司风险管理人员的监督检查。

### 第三章 授权制度

第九条 与经纪公司订立的开户合同应按公司签订合同的有关规定及程序审核

后，由事聚贸易法定代表人或经法定代表人授权的人员签署。

第十条 事聚贸易对期货交易操作实行授权管理。交易授权书应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；期货交易授权书由事聚贸易法定代表人或经法定代表人授权的人员签署。

第十一条 被授权人员只有在取得书面授权后方可在授权范围内进行操作。

第十二条 如被授权人发生变动，授权人应立即通知业务相关各方。自通知之时起，原被授权人不再享有被授权的一切权利。

#### 第四章 业务流程

第十三条 期货业务部会同市场部、财务部等部门根据事聚贸易具体经营情况和产品市场价格行情，共同制定套期保值操作方案，经事聚贸易期货业务领导小组批准后方可执行。

第十四条 资金调拨员根据事聚贸易的保证金情况，确定保值头寸限额，并通知交易员。

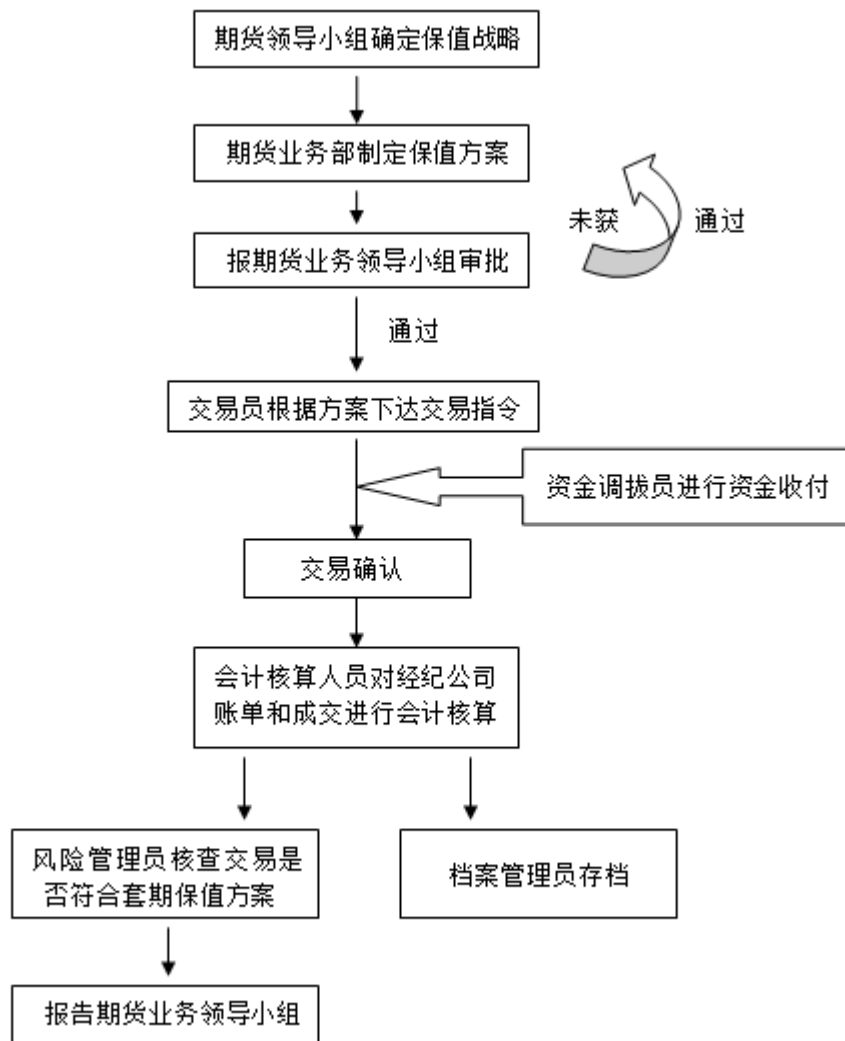
第十五条 交易员根据事聚贸易的套期保值方案选择合适的时机向经纪公司下达指令交易。

第十六条 每日交易结束后，交易员应及时将当日成交明细、结算情况及经纪公司发来的账单传递给部门经理、风险管理员和会计核算人员。

第十七条 风险管理员核查交易是否符合套期保值方案并收集相关书面材料做档案前期处理工作，若不符合，须立即报告事聚贸易期货业务领导小组。

第十八条 事聚贸易根据实际情况，如果需要进行实物交割了结期货头寸时，应提前对现货产品采购销售人员、交易员及资金调拨员等相关各方进行妥善协调，以确保交割按期完成。

第十九条 事聚贸易的期货套期保值业务流程如下：



## 第五章 风险管理制度

第二十条 事聚贸易在开展期货套期保值业务前须做到：

- 1、认真选择期货经纪公司；
- 2、合理设置期货业务组织机构和选择安排相应岗位的业务人员：

(1) 事聚贸易期货业务岗位设置应严格按照本制度“第二章组织机构” 执行；

(2) 期货业务人员要求：

- 1) 有较强经济基础知识及管理经验、有良好的职业道德；
- 2) 有较高的业务技能，熟悉期货交易相关的法律、法规，遵守法律、法规及交易的各项规章制度，规范自身行为，杜绝违法、违规行为。

第二十一条 事聚贸易设置风险管理岗位，主要职责包括：

- 1、制定期货业务有关的风险管理政策及管理工作程序；

- 2、监督期货业务有关人员执行风险管理政策和风险管理工作程序；
- 3、审查经纪公司的资信情况；
- 4、审核公司的具体保值方案；
- 5、核查交易员的交易行为是否符合套期保值计划和具体交易方案；
- 6、对期货头寸的风险状况进行监控和评估，保证套期保值过程的正常进行；
- 7、发现、报告，并按程序处理风险事故；
- 8、评估、防范和化解公司期货业务的法律风险。

第二十二條 事聚貿易期貨開戶及經紀合同簽訂程序如下：

- 1、事聚貿易期貨業務部選擇具有良好資信和業務實力的期貨經紀公司，推薦給期貨業務領導小組，作為事聚貿易期貨交易的備選經紀公司；
- 2、事聚貿易期貨業務領導小組從中選擇確定公司期貨經紀公司；
- 3、事聚貿易法定代表人或經法定代表人書面授權的人員代表公司與期貨經紀公司簽訂期貨套期保值業務經紀合同，並辦理開戶工作。

第二十三條 期貨業務部應隨時跟蹤了解經紀公司的發展變化和資信情況，並將有關發展變化情況報告事聚貿易期貨業務領導小組，以便事聚貿易根據實際情況來選擇或更換經紀公司。

第二十四條 風險管理員須嚴格審核期貨保值是否為事聚貿易所需產品進行的保值，若不是，則須立即報告期貨業務領導小組。

第二十五條 事聚貿易期貨業務領導小組按照不同月份的事聚貿易實際經營情況來確定和控制當期的套期保值量，不得超過公司董事會授權範圍進行保值。

第二十六條 事聚貿易在已經決定對實物進行套期保值的情況下，期貨頭寸的建立、平倉要與所保值的實物合同在數量上及時間上相匹配。

第二十七條 事聚貿易建立風險測算系統如下：

- 1、資金風險：測算已占用的保證金數量、浮動盈虧、可用保證金數量及擬建頭寸需要的保證金數量、事聚貿易對可能追加的保證金的準備數量；
- 2、保值頭寸價格變動風險：根據事聚貿易套期保值方案測算已建倉頭寸和需建倉頭寸在價格出現變動後的保證金需求和盈虧風險。

第二十八條 事聚貿易建立內部風險報告制度和風險處理程序：

1、內部風險報告制度：

(1) 當期貨市場價格波動較大或發生異常波動的情況時，交易員應立即報告部門經理和風險管理員；部門經理和風險管理員應立即報告事聚貿易期貨業務領導小組和風險控制部。

(2) 当发生以下情况时，风险管理员应立即向事聚贸易期货业务领导小组和风险控制部报告：

- ①期货业务有关人员违反风险管理政策和风险管理工作程序；
- ②经纪公司的资信情况不符合公司的要求；
- ③具体套期保值方案不符合有关规定；
- ④交易员的交易行为不符合套期保值方案；
- ⑤期货头寸的风险状况影响到套期保值过程的正常进行；
- ⑥期货业务出现或将出现有关的法律风险。

## 2、风险处理程序：

(1) 事聚贸易董事长及时召开期货业务领导小组和有关人员参加的会议分析讨论风险情况及应采取的对策；

(2) 相关人员执行事聚贸易的风险处理决定。

3、公司相关部门有权采用定期或不定期的方式，对事聚贸易套期保值业务进行检查，并将检查结果向公司董事会报告。

## 第二十九条 事聚贸易交易错单处理程序：

1、当发生属经纪公司过错的错单时：由交易员通知经纪公司，并由经纪公司及时采取相应错单处理措施，再向经纪公司追偿产生的直接损失；

2、当发生属于事聚贸易交易员过错的错单时，及时上报事聚贸易期货业务领导小组，采取相应的交易指令，要求能消除或尽可能减小错单对公司造成的损失。

第三十条 事聚贸易应合理计划和安排使用保证金，保证套期保值过程正常进行。应合理选择保值月份，避免市场流动性风险。

第三十一条 事聚贸易严格按照规定安排和使用期货专业人士、风险管理员，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

第三十二条 事聚贸易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。

## 第六章 档案管理制度

第三十三条 事聚贸易对期货套期保值的交易原始资料、结算资料等业务档案保存至少10年。

第三十四条 事聚贸易对期货业务开户文件、授权文件等档案应保存至少10年。

## 第七章 保密制度

第三十五条 事聚贸易期货业务相关人员应遵守公司的保密制度。

第三十六条 事聚贸易期货业务相关人员未经允许不得泄露套期保值方案、交易情况、结算情况、资金状况等与事聚贸易期货交易有关的信息。

## 第八章 法律责任

第三十七条 本管理制度规定所涉及的交易指令、资金拨付、下单、结算、风控等各有关人员，严格按照规定程序操作的，交易风险由事聚贸易承担。超越权限进行的资金拨付、交易等行为，由越权操作者对交易风险或者损失承担个人责任。

第三十八条 相关人员违反本管理制度规定进行资金拨付和下单交易或违反保密制度，因此给事聚贸易造成的损失，事聚贸易有权采取扣留工资奖金、向人民法院起诉等合法方式，向其追讨损失。其行为依法构成犯罪的，由事聚贸易向司法机关报案，追究刑事责任。

## 第九章 附则

第三十九条 本管理制度未尽事宜，依照法律、法规和《公司章程》有关规定执行。

第四十条 公司从事低风险稳健性期货套利交易，可参照本制度执行，且必须获得公司明确授权；交易保证金额度应与公司套保交易保证金合并计算，且不超过本制度第三条规定的额度范围。

第四十一条 本管理制度自公司董事会审议通过后施行，修改时亦同。

第四十二条 本管理制度由公司董事会负责解释。