

证券代码：874539 证券简称：四维材料 主办券商：东莞证券

东莞四维材料科技股份有限公司期货交易管理制度

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

一、 审议及表决情况

本制度经 2025 年 10 月 15 日召开的第一届董事会第十三次会议审议通过，无需提交股东会审议。

二、 分章节列示制度的主要内容

东莞四维材料科技股份有限公司 期货交易管理制度

第一章 总 则

第一条 为了规范东莞四维材料科技股份有限公司（以下简称“公司”）期货交易业务，有效防范和控制风险，根据《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国证券法》等法律、法规及规范性文件以及《东莞四维材料科技股份有限公司章程》（以下简称《公司章程》）、《东莞四维材料科技股份有限公司对外投资管理制度》（以下简称《对外投资管理制度》）的有关规定，结合公司的实际情况，制定本制度。

第二条 本制度适用于公司及控股子公司的期货交易业务。控股子公司的期货交易业务由公司进行统一管理、操作。未经公司批准同意，控股子公司不得擅自开展期货交易业务。

第三条 公司进行期货交易业务，应遵循以下基本原则：

（一）交易的品种主要为公司生产经营所需的主要原材料及物资等。在不影

响正常经营、操作合法合规的前提下，选择适当的时机进行原材料及物资的期货交易，目的系为能在现货市场的价格波动中把握节奏，降低现货采购成本波动风险；

（二）公司的期货交易业务，只限于在境内期货交易所进行场内市场交易，不得进行场外市场交易；

（三）公司应具有与期货交易保证金相匹配的自有资金。公司应科学调度期货交易业务的资金，并应严格控制期货交易的资金规模，不得影响公司正常经营；

（四）期货交易账户须以公司或子公司名义开立，公司不得使用他人账户或向他人提供资金进行期货交易。

第二章 审批权限

第四条 公司进行期货交易的单笔或累计保证金额度参照《公司章程》《对外投资管理制度》中所规定对外投资审批权限提交公司董事会或股东会批准。

第五条 公司因交易频次和时效要求等原因难以对每次期货交易业务履行审议程序和披露义务的，可以对未来 12 个月内期货交易业务的范围、额度及期限等进行合理预计并审议。相关额度的使用期限不应超过 12 个月，期限内任一时点的金额（含使用前述交易的收益进行交易的相关金额）不应超过已审议额度。

第三章 组织机构及工作职责

第六条 公司董事会或股东会为期货交易业务的决策机构，未经授权，其他部门和个人无权作出进行期货交易业务的决定。

第七条 公司董事会授权总经理组织建立期货交易工作小组（以下简称“工作小组”），负责公司及控股子公司期货交易的相关业务，由公司总经理、财务负责人、董事会秘书以及其他期货操作相关人员组成，公司总经理为工作小组负责人。

第八条 工作小组的主要职责如下：

- （一）负责拟定和完善公司期货交易管理规章制度；
- （二）负责期货产品市场信息收集、研究、分析，制定相应的期货交易策略；

（三）负责召开工作小组会议，制订期货交易计划，并根据《公司章程》《对外投资管理制度》规定的审议标准及要求提交董事会或股东会审议；

（四）负责期货交易业务日常管理职能，包括开销户、交易软件及行情软件账户的申请、设置及使用等日常管理；

（五）负责期货交易额度申请及额度使用情况的监督管理，负责期货交易开、平仓申请、审核、资金到位等日常业务，交割管理和盘中交易风险的实时监控，不得进行投机交易；

（六）跟踪期货交易业务公开市场价格或者公允价值的变化，及时跟踪期货交易业务与已识别风险敞口对冲后的净敞口价值变动，并向管理层和董事会报告交易业务授权执行情况、交易头寸情况、风险评估结果、交易盈亏状况、止损规定执行情况等，对交易效果进行持续评估；

（七）行使董事会授权的其他期货交易业务相关职责。

第九条 公司财务部门负责拟定期货交易策略，整理期货交易结算数据，负责资金划拨、资金使用和持仓情况的监督等，确保资金安全；负责期货交易和交割的相关账务处理、核算期末盈亏情况；负责沟通处理期货交易和交割中出现的各项税务问题。

第十条 公司内审部门应定期或不定期地对期货交易业务进行检查，监督期货交易业务人员执行风险管理政策和风险管理工作程序，及时防范业务中的操作风险。

第四章 业务操作流程

第十一条 财务部门提供公司主要原材料或产品的期货市场行情、库存情况，工作小组制定期货交易策略并根据市场情况下达交易指令，期货交易策略应同步向公司内审部门、董事会秘书办公室报备。

第十二条 公司授权的期货交易业务经办人员根据期货交易所需保证金，填写注入或追加保证金的付款通知，根据公司相关资金审批制度规定审批同意后交财务部门执行付款。资金划拨按公司资金操作流程处理。

第十三条 期货交易业务经办人员根据工作小组指示向期货经纪公司下达指令交易。

第十四条 期货交易业务经办人员应定期出具期货交易业务报表，并报送公司工作小组。报表内容至少应包括交易时间、交易标的、金额、盈亏情况等。

第十五条 公司内审部门在开展定期或不定期抽查期货交易业务操作情况的过程中，若发现与期货交易策略不符的情形，须立即向公司董事会审计委员会报告。

第五章 内部风险控制及处理程序

第十六条 公司在开展期货交易业务前，应充分考虑、评估可能出现的各种风险因素，制定切实可行的风险控制措施，操作过程中严密监控、严防风险，出现风险及时处理。

第十七条 公司期货交易经办人员应随时跟踪了解期货经纪公司的发展变化和资信情况，并将有关发展变化情况报告公司工作小组，以便公司根据实际情况来决定是否更换期货经纪公司。

第十八条 公司工作小组应对如下风险进行测算：

（一）资金风险：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、公司对可能追加保证金的准备数量；

（二）保值头寸价格变动风险：根据公司期货交易策略测算已建仓头寸和需建仓头寸在价格出现变动后的保证金需求和盈亏风险。

第十九条 当发生以下情况时，期货交易业务经办人员应立即向工作小组报告：

- （一）期货交易业务有关人员违反风险管理政策和风险管理工作程序；
- （二）期货经纪公司的资信情况发生重大负向变化或不符合公司的要求；
- （三）公司的具体保值方案不符合有关规定；
- （四）期货交易业务人员的交易行为不符合期货交易策略；
- （五）公司期货头寸的风险状况影响到期货交易业务过程的正常进行；
- （六）公司期货业务出现或将出现有关的法律风险。

第二十条 风险处理程序：

（一）公司管理层及时召集公司工作小组和有关人员参加会议，分析讨论风险情况及应采取的对策，合理选择保值月份，避免市场流动性风险；

(二)相关人员严格执行公司的风险处理决定,合理计划和安排使用保证金,保证期货交易过程正常进行。

第二十一条 交易错单处理程序:

(一)当发生属期货经纪公司过错的错单时,由经办人员立即通知期货经纪公司,并由期货经纪公司采取相应处理措施,再向期货经纪公司追偿产生的损失;

(二)当发生属于公司经办人员过错的错单时,经办人员应立即报告公司工作小组负责人,并立即下达相应的指令,相应的交易指令要求能消除或尽可能减少错单给公司造成的损失。

第二十二条 公司执行期期货交易策略时,如遇国家政策、市场发生重大变化等原因,导致继续进行该业务将造成风险显著增加、可能引发重大损失时,应按权限及时主动报告,并在最短时间内平仓或锁仓。

第二十三条 若遇地震、泥石流、滑坡、水灾、火灾、台风、暴乱、骚乱、战争等不可抗力原因导致的损失,按期货行业相关法律法规、期货合约及相关合同的规定处理。

第二十四条 如本地发生停电、计算机及企业网络故障使交易不能正常进行的,公司应及时启用备用无线网络、笔记本电脑等设备或通过电话等方式委托期货经纪公司进行交易。

第六章 信息披露

第二十五条 公司应按照中国证券监督管理委员会、证券交易所/全国中小企业股份转让系统的有关规定,披露公司开展商品期货交易业务的相关信息。

第七章 档案管理及保密制度

第二十六条 公司期货交易业务的交易原始资料、结算资料、交易台账、授权文件、各类内部报告、发文及批复文件等档案由财务部门负责保管,保管期限不少于 10 年。

第二十七条 公司期货交易信息为公司商业秘密,期货交易业务相关人员及合作的期货经纪公司相关人员等知情人均应对期货交易的方案、交易时间、建仓

价格、持仓头寸、资金状况等信息保密，未经允许不得泄露与公司期货交易业务有关的任何信息。

第二十八条 违反本制度规定进行的资金拨付、期货交易等行为，或违反本制度规定的报告、保密等义务的，由行为人对交易风险或者损失承担个人责任。公司将区分不同情况，对违规行为人给予公司内部处分、追究民事赔偿责任等；违规行为人的行为构成犯罪的，公司将依法移交司法机关，追究其刑事责任。

第八章 附 则

第二十九条 本制度未尽事宜，按国家有关法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的规定执行。本制度如与法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的有关规定不一致的，按法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的相关规定执行。

第三十条 本制度由董事会负责制定、修订和解释。

第三十一条 本制度经公司董事会审议通过之日起生效并施行。

东莞四维材料科技股份有限公司

董事会

2025 年 10 月 16 日