

江苏东方盛虹股份有限公司 期货和衍生品交易管理制度

（2025年12月5日，经公司第九届董事会第三十三次会议审议通过）

第一章 总则

第一条 为规范江苏东方盛虹股份有限公司（以下简称“公司”）的衍生品交易行为，建立完善有序的投资决策管理机制，有效防范投资风险，确保公司资产安全，根据《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国证券法》《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第7号——交易与关联交易》等法律法规、规范性文件以及《江苏东方盛虹股份有限公司章程》（以下简称“《公司章程》”）的有关规定，结合公司的实际情况，制定本制度。

第二条 本制度所称期货交易是指以期货合约或者标准化期权合约作为交易标的的交易活动。本制度所称衍生品交易是指期货交易以外的，以互换合约、远期合约和非标准化期权合约及其组合为交易标的的交易活动。期货和衍生品的基础资产既可以是证券、指数、利率、汇率、货币、商品等标的，也可以是上述标的的组合。

第三条 公司进行期货和衍生品交易的资金来源应当为公司自有资金。公司应当合理安排、使用资金，致力发展公司主营业务，不得使用募集资金从事期货和衍生品交易。公司从事套期保值业务的期货和衍生品品种应当仅限于与公司生产经营相关的产品或者所需的原材料。

第四条 公司从事期货和衍生品交易，应当遵循合法、审慎、安全、有效的原则，建立健全内控制度，控制投资风险、注重投资效益。

公司应当分析投资的可行性与必要性，制定严格的决策程序、报告制度和监控措施，明确授权范围、操作要点与信息披露等具体要求，并根据公司的风险承受能力确定投资规模及期限。

第五条 公司拟在境外开展期货和衍生品交易的，应当审慎评估交易必要性和在相关国家和地区开展交易的政治、经济和法律等风险，充分考虑结算便捷性、交易流动性、汇率波动性等因素。

公司拟开展场外期货和衍生品交易的，应当评估交易必要性、产品结构复杂程度、流动性风险及交易对手信用风险。

第六条 公司全资子公司、控股子公司（以下合称“子公司”）发生的期货和衍生品交易，视同公司行为，适用本制度的规定。未经公司同意，子公司不得进行期货和衍生品交易。

第二章 期货和衍生品交易的管理与监督

第七条 董事长指定专门部门或专人牵头建立期货和衍生品交易工作小组（以下简称“工作小组”），合理配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员，负责期货和衍生品交易业务的相关事宜。

第八条 工作小组应当制定具体操作规则或交易制度，针对各类期货和衍生品或者不同交易对手设定适当的止损限额，明确止损处理业务流程，并严格执行止损规定。工作小组应当控制现货、期货和衍生品在种类、规模及时间上相匹配，并制定切实可行的应急处理预案，以及时应对交易过程中可能发生的重大突发事件。

第九条 工作小组应当跟踪期货和衍生品公开市场价格或者公允价值的变化，及时评估已交易期货和衍生品的风险敞口变化情况，每季度向董事长和董事会提交包括期货和衍生品交易授权执行情况、交易头寸情况、风险评估结果、本期期货和衍生品交易盈亏状况、止损限额执行情况等内容风险分析报告。

第十条 公司内部审计机构负责对期货和衍生品交易项目的审计与监督。

第三章 期货和衍生品交易的决策权限

第十一条 公司进行期货和衍生品交易的决策权限如下：

工作小组应当就期货和衍生品交易出具可行性分析报告并提交公司董事会，董事会审议通过并及时披露后方可执行。董事会审计委员会审查和监督公司期货和衍生品交易的必要性及风险控制情况，及时识别相关内部控制缺陷并采取补救措施，必要时可以聘请专业机构就期货和衍生品交易出具可行性分析报告。

期货和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）占公司最近一期经审计净利润的50%以上，且绝对金额超过五百万元人民币；

（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，且绝对金额超过五千万元人民币；

(三) 公司从事不以套期保值为目的的期货和衍生品交易。

第十二条 公司进行期货和衍生品交易，如因交易频次和时效要求等原因难以对每次投资交易履行审议程序和披露义务的，可对上述事项的投资范围、投资额度及期限等进行合理预计，以额度金额为标准适用审议程序和信息披露义务的相关规定。相关额度的使用期限不应超过12个月，期限内任一时点的期货和衍生品交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过投资额度。

第十三条 董事会在审议期货和衍生品交易等高风险投资等事项时，董事应当充分关注公司是否建立专门内部控制制度，投资风险是否可控以及风险控制措施是否有效，投资规模是否影响公司正常经营，资金来源是否为自有资金，是否存在违反规定的投资等情形。

第四章 期货和衍生品交易的报告与披露

第十四条 公司董事会秘书为期货和衍生品交易信息披露义务的直接责任人，负责公司期货和衍生品交易信息的对外公布，其他董事、高级管理人员及相关知情人员，非经董事会书面授权，不得对外发布任何公司未公开的投资信息。

第十五条 期货和衍生品交易实施过程中，发现投资方案有重大漏洞、项目投资实施的外部环境发生重大变化或受到不可抗力的影响、项目有实质性进展或实施过程中发生重大变化时，相关负责人或其他信息知情人应第一时间向公司董事长、董事会秘书报告。

第十六条 公司期货和衍生品交易已确认损益及浮动亏损金额每达到公司最近一年经审计的归属于公司股东净利润的10%且绝对金额超过一千万元人民币的，应当及时披露。公司开展套期保值业务的，可以将套期工具与被套期项目价值变动加总后适用前述规定。

第五章 违规责任

第十七条 由于工作失职或违反相关法律法规、本制度相关规定，除证券监管机构依法对相关责任人进行处罚外，公司还将视影响程度和情节轻重给予相关责任人相应的处分并追究其法律责任；相关责任人给公司造成经济损失的，公司将向其追偿损失；涉嫌违法或犯罪的，公司将按相关法律法规的规定移送司法机关进行处理。

第六章 附则

第十八条 本制度未尽事宜或与本制度生效后颁布、修改的相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件、深圳证券交易所其他规定或《公司章程》等相冲突的，按照相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件、深圳证券交易所其他规定和《公司章程》的

规定执行。

第十九条 本制度由公司董事会负责解释、修订，自董事会审议通过之日起生效，修改时亦同。

江苏东方盛虹股份有限公司

2025年12月