

云南能源投资股份有限公司

风险投资管理制度

第一章 总 则

第一条 为规范云南能源投资股份有限公司（下称“公司”）进行风险投资行为，防范投资风险，强化风险控制，保护投资者的权益和公司利益，根据《中华人民共和国证券法》《深圳证券交易所股票上市规则》（下称“《上市规则》”）《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第1号—主板上市公司规范运作》（下称“《规范运作》”）等法律、法规、规范性文件以及《云南能源投资股份有限公司章程》（以下简称“《公司章程》”）的有关规定，结合本公司的实际情况，特制定本制度。

第二条 本制度所称的风险投资指公司从事证券投资、衍生品交易的投资行为。

本条所述证券投资，包括新股配售或者申购、证券回购、股票及存托凭证投资、债券投资以及深圳证券交易所认定的其他投资行为。

本条所述衍生品，是指远期、期货、掉期(互换)和期权等产品或者混合上述产品特征的金融工具。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。

以下情形不适用本制度：

- （一）作为公司或其控股子公司主营业务的证券投资与衍生品交易行为；
- （二）固定收益类或者承诺保本的投资行为；
- （三）参与其他上市公司的配股或者行使优先认购权利；
- （四）购买其他上市公司股份超过总股本的10%，且拟持有三年以上的证券投资；
- （五）公司首次公开发行股票并上市前已进行的投资。

第三条 风险投资的原则：

- （一）公司的风险投资应遵守国家法律、法规、规范性文件等相关规定；
- （二）公司的风险投资应当谨慎、强化风险控制、合理评估效益；
- （三）公司的风险投资必须与资产结构相适应，规模适度，量力而行，不能影响自身主营业务的正常运行。

第四条 公司风险投资的资金来源为公司自有资金。公司应严格控制风险投资的资金规模，不得影响公司正常经营，不得使用募集资金进行风险投资。

第二章 风险投资的决策和管理

第五条 公司进行风险投资的，应当按《公司章程》规定履行相应的审批程序。

第六条 董事会在审议证券投资与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相关专门内部控制制度的建立及施行情况，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。

第七条 公司进行证券投资与衍生品交易，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，期限内任一时点的证券投资与衍生品交易金额(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。

第三章 风险投资的管理

第八条 公司从事衍生品交易的，应当合理配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员，审查衍生品交易的必要性及风险控制情况。必要时，公司可以聘请专业机构就衍生品交易出具可行性分析报告。公司从事衍生品交易，应当控制现货与衍生品在种类、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 公司应当跟踪衍生品公开市场价格或者公允价值的变化，及时评估已交易衍生品的风险敞口变化情况，并向管理层和董事会提交包括衍生品交易授权执行情况、衍生品交易头寸情况、风险评估结果、本期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 公司董事会或股东会可授权公司管理层处理风险投资的具体实施事宜，授权公司总经理作为风险投资项目的运作和处置的直接责任人，具体负责风险投资项目的运作和处置。

公司应当针对各类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。

第十一条 公司审计委员会应对公司风险投资资金使用情况进行监督。

第十二条 公司在风险投资项目有实质性进展或实施过程发生变化时，相关责任人应在第一时间(一个工作日内)向总经理报告并同时告知董事会秘书，总经理应立即向董事会报告。

第十三条 公司财务管理部门负责风险投资项目资金的筹集、支付和使用管理。

第十四条 公司内审部门负责对风险投资项目的审计与监督，每个会计年度末应对所有风险投资项目进行全面检查，并根据谨慎性原则，合理的预计各项风险投资可能发生的收益和损失，并向审计委员会报告。

第十五条 公司审计委员会应当督导内审部门至少每半年对公司风险投资事项的实施情况进行检查，出具检查报告并提交审计委员会。检查发现公司存在违法违规、运作不规范等情形的，应当及时督促改正，并向深圳证券交易所报告。

第四章 风险投资的信息披露

第十六条 公司董事会应当持续跟踪证券投资与衍生品交易的执行进展和投资安全状况，如出现投资发生较大损失等异常情况的，应当立即采取措施并按规定履行披露义务。

第十七条 公司应当按照《上市规则》《规范运作》以及相关法律法规规定履行风险投资的信息披露义务。

第五章 其 他

第十八条 公司在调研、洽谈、评估风险投资项目时，内幕信息知情人对已获知的未公开的信息负有保密的义务，不得擅自以任何形式对外披露。由于工作失职或违反本制度规定，给公司带来严重影响或损失的，公司将根据内部管理制度给予该责任人相应的处分；涉嫌犯罪的，将案件移送司法机关处理。

第十九条 本制度适用于公司及控股子公司的风险投资行为。未经本公司同意，公司控股子公司不得进行风险投资；公司参股公司进行风险投资，对公司业绩造成较大影响的，应当参照本制度相关规定履行信息披露义务。

第六章 附 则

第二十条 本制度自董事会决议通过之日起生效并实施，修改时亦同。

第二十一条 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；本制度如与国家法律、行政法规或规范性文件以及公司章程相抵触时，执行国家法律、行政法规或规范性文件以及公司章程的规定。

第二十二条 本制度解释权、修订权属于公司董事会。