

无锡信捷电气股份有限公司

证券投资、期货与衍生品交易管理制度

(2026年4月)

第一章 总则

第一条 为规范无锡信捷电气股份有限公司（以下简称“公司”）的证券投资、期货与衍生品交易行为，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《中华人民共和国公司法》《中华人民共和国证券法》《上海证券交易所股票上市规则》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第5号——交易与关联交易》等相关法律法规、规范性文件以及《无锡信捷电气股份有限公司章程》（以下简称“《公司章程》”）的有关规定，结合公司实际情况，特制定本制度。

第二条 公司进行证券投资、期货与衍生品交易，应当严格按照本制度的决策程序、报告制度和风控措施履行，并根据公司的风险承受能力确定投资及交易规模。

第二章 定义与适用排除

第三条 本制度所称证券投资，包括新股配售或者申购、证券回购、股票及存托凭证投资、债券投资以及上海证券交易所认定的其他投资行为。

下列证券投资情形不适用本制度规定：

- （一）固定收益类或者承诺保本的投资行为；
- （二）参与其他上市公司的配股或者行使优先认购权利；
- （三）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。

第四条 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为交易

标的的交易活动。

第五条 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，包括远期、掉期（互换）、期权、外汇衍生品、商品衍生品及其组合产品等；基础资产包括利率、汇率、货币、商品、证券、指数等。

第三章 业务操作原则

第六条 公司应当合理安排、使用资金，具有与从事证券投资、期货与衍生品业务保证金相匹配的自有资金；公司应当致力发展主营业务，不得使用募集资金从事证券投资、期货与衍生品交易。

第七条 公司从事证券投资、期货与衍生品交易应遵循合法、审慎、安全、有效的原则；所有期货与衍生品交易均以正常经营及日常业务为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率、利率、商品价格风险为目的，不影响公司正常经营，原则上不得进行以投机为目的的交易。

第八条 公司期货与衍生品交易应当基于公司合理谨慎预测的销售业务、采购业务及其他涉及风险敞口业务项下的需求，以套期保值为主要目的，以公司风险敞口预测数据为主要依据，确保交易品种、规模、期限与实际风险敞口相匹配。

第九条 公司只允许与具有期货、衍生品业务经营资格的金融机构、期货公司开展相关交易，严禁与无合法经营资质的主体开展交易。证券投资及委托理财应选择资信良好、无不良诚信记录、具备专业资质的受托方。

第十条 公司拟在境外开展期货与衍生品交易的，应当审慎评估交易必要性和在相关国家/地区开展交易的政治、经济、法律等风险；拟开展场外衍生品交易的，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。

第十一条 公司进行证券投资、期货与衍生品交易必须以公司名义进行，不得使用他人账户；实行决策、操作、风控、财务岗位分离原则，相关人员不得相互兼任。

第四章 审批决策权限

第十二条 公司证券投资、期货与衍生品交易实行分级审批，决策机构为股东会、董事会，任何交易不得越权审批。

第十三条 公司证券投资审批权限：

（一）证券投资金额占公司最近一期经审计净资产绝对值 10% 以上且不超过 50%，或绝对金额超过 1000 万元且低于 5000 万元的，应当经董事会审议通过并及时履行信息披露义务；

（二）证券投资交易金额占公司最近一期经审计净资产绝对值 50%以上且金额超过 5000 万元的，应当在董事会审议通过后提交股东会审议。

前款所称“证券投资金额”，是指连续十二个月内公司证券投资发生的累计金额或任一时点持有的最高投资余额。公司可以对未来 12 个月内证券投资的范围、额度及期限进行合理预计，并按照上述权限履行审议程序。期限内任一时点的交易金额（含收益再投资金额）不应超过经审议的额度。

第十四条 公司从事期货与衍生品交易，应当编制可行性分析报告并提交董事会审议；董事会审计委员会应当审查交易的必要性、可行性及风险控制情况，必要时可以聘请专业机构出具可行性分析报告。

期货与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、应急预留保证金等）占公司最近一期经审计净利润绝对值 50%以上且绝对金额超过 500 万元；

（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绝对值 50%以上且绝对金额超过 5000 万元；

（三）公司从事不以套期保值为目的的期货与衍生品交易。

第十五条 公司因交易频次和时效要求等原因难以对每次证券投资、期货与衍生品交易履行审议程序和披露义务的，可以对未来 12 个月内相关交易的范围、

额度及期限等进行合理预计，额度金额超出董事会权限范围的，还应当提交股东会审议。

相关额度的使用期限不应超过 12 个月，期限内任一时点的交易金额（含收益再投资、再交易金额）不应超过经审议的额度。

第十六条 公司开展证券投资、期货与衍生品交易涉及关联交易的，须同时遵守公司关联交易管理制度，履行关联回避、审批及信息披露程序。

第五章 日常管理和风险控制

第十七条 公司管理层在董事会或股东会授权范围内签署证券投资、期货与衍生品交易相关协议、合同；董事会秘书组织相关部门履行信息披露义务。

第十八条 公司参与证券投资、期货与衍生品交易的人员须具备相应专业知识及管理经验，必要时可聘请外部专业机构提供咨询服务。

第十九条 公司指定相关部门为证券投资日常管理部门，负责投资可行性分析、方案制定、交易操作与日常监控，操作流程如下：

- （一）结合公司产业布局开展投资分析与风险评估，制定投资方案；
- （二）方案经审核、批准后履行审批程序；
- （三）通知资金管理部门拨付资金，实施投资；
- （四）持续监控投资标的价格及重大信息，异常情况及时上报；
- （五）达到处置条件时，出具处置报告并执行退出。

第二十条 公司资金管理部门为期货与衍生品交易日常管理部门，负责交易风控、方案制定、资金筹集、业务操作，操作流程如下：

- （一）结合实际业务制定交易方案，评估风险并经财务负责人审批；
- （二）按审批方案开展交易、签署合同；
- （三）逐笔登记交易信息，跟踪交易状态与交割资金，杜绝交割违约；
- （四）制定应急处置预案，设定止损限额（亏损预警线）并严格执行；

(五)跟踪衍生品公允价值,评估风险敞口与套期保值效果,定期报送风险报告。

第二十一条 公司财务部对证券投资、期货与衍生品交易建立专项台账,详细记录交易信息、资金流水、盈亏情况,定期核对确保数据准确。

第二十二条 当相关业务出现重大风险时,公司应立即分析解决方案,董事会或其授权人及时制定应对措施,控制损失扩大。

第二十三条 公司内部审计部门至少每半年对证券投资、期货与衍生品交易事项进行一次检查,发现违法违规、运作不规范情形的,及时向董事会审计委员会报告。

第六章 信息披露

第二十四条 公司应按照中国证监会及上海证券交易所规定,披露证券投资、期货与衍生品交易相关信息。

第二十五条 公司拟开展期货与衍生品交易的,应当披露交易目的、品种、工具、场所、预计保证金及权利金上限、最高合约价值、专业人员配备等,并进行充分风险提示。

以套期保值为目的的,应说明衍生品类别、风险敞口、对冲关系及保值效果;以投机为目的的,不得使用套期保值、风险管理等表述,如实披露交易目的。

第二十六条 公司期货与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归属于股东净利润绝对值 10%且绝对金额超过 1000 万元的,应当及时披露;开展套期保值业务的,可将套期工具与被套期项目价值变动加总后适用前述规定。

套期保值业务出现前款亏损情形的,还应重新评估套期关系有效性,披露未按预期抵销的原因及相关价值变动情况。

第二十七条 公司开展套期保值业务的,可在定期报告中结合被套期项目全面披露保值效果;不适用套期会计但能实现风险管理目标的,应说明相关情况。

第二十八条 公司证券投资达到董事会、股东会审议标准的,应及时披露投

资目的、品种、金额、资金来源、风控措施等信息。

第七章 监督管理及责任追究

第二十九条 董事会审计委员会应当督导内部审计部门开展检查，发现违规情形及时向上海证券交易所报告；加强对交易风控政策与程序的监督，及时整改内部控制缺陷。

第三十条 对违反法律法规及本制度开展相关业务、疏于管理造成重大损失的人员，公司严肃处理并依法追究责任。

第三十一条 对报告虚假信息、隐瞒资产损失、未及时报告或不配合监督管理的人员，公司依法追究责任。

第三十二条 因违规操作、失职渎职给公司造成损失的，相关责任人承担全部赔偿责任；涉嫌违法犯罪的，移交司法机关处理。

第八章 附则

第三十三条 本制度未尽事宜，按照有关法律法规、规范性文件和《公司章程》等相关规定执行；本制度与新颁布法律法规、规范性文件或《公司章程》抵触的，按新规定执行。

第三十四条 本制度所称“以上”“以下”含本数，“超过”“低于”不含本数。

第三十五条 本制度由公司董事会负责解释和修订。

第三十六条 本制度经公司董事会审议通过之日起生效。

无锡信捷电气股份有限公司

2026年4月25日