北京海兰信数据科技股份有限公司

证券投资、期货及衍生品交易管理制度

二〇二六年十一月

北京海兰信数据科技股份有限公司

证券投资、期货及衍生品交易管理制度

第一章 总则

第一条 为规范北京海兰信数据科技股份有限公司（以下简称“公司”）的证券投资、期货及衍生品交易及相关信息披露行为，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》、《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《公司章程》的有关规定，制定本制度。

第二条 本制度所称的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。

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 以下情形不适用本制度：

（一） 作为公司或控股子公司主营业务的证券投资、期货及衍生品交易行为；

（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。

第四条 公司从事证券投资、期货及衍生品交易的原则

（一） 应遵守国家法律、法规、规范性文件等相关规定；

（二） 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，根据公司的风险承受能力确定投资规模及期限。

（三） 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。

第五条 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证券投资、期货及衍生品交易。

公司应当以本公司（或全资子公司）名义设立账户进行证券投资、期货及衍生品交易，不得使用他人账户或向他人提供资金进行证券投资、期货及衍生品交易。对于参股公司进行类似投资和交易的风险应密切关注。

第六条 公司从事套期保值业务，是指为管理外汇风险、价格风险、利率风险、信用风险等特定风险而达成与上述风险基本吻合的期货和衍生品交易的活动。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、原材料和外汇等，且原则上应当控制期货和衍生品在种类、规模及期限上与需管理的风险敞口相匹配。用于套期保值的期货和衍生品与需管理的相关风险敞口应当存在相互风险对冲的经济关系，使得相关期货和衍生品与相关风险敞口的价值因面临相同的风险因素而发生方向相反的变动。

本制度所述套期保值业务主要包括以下类型的交易活动：

（一） 对已持有的现货库存进行卖出套期保值；

（二） 对已签订的固定价格的购销合同进行套期保值，包括对原材料采购合同进行空头套期保值、对产成品销售合同进行多头套期保值，对已定价贸易合同进行与合同方向相反的套期保值；

（三） 对已签订的浮动价格的购销合同进行套期保值，包括对原材料采购合同进行多头套期保值、对产成品销售合同进行空头套期保值，对浮动价格贸易合同进行与合同方向相同的套期保值；

（四） 根据生产经营计划，对预期采购量或预期产量进行套期保值，包括对预期原材料采购进行多头套期保值、对预期产成品进行空头套期保值；

（五） 根据生产经营计划，对拟履行进出口合同中涉及的预期收付汇进行套期保值；

（六） 根据投资融资计划，对拟发生或已发生的外币投资或资产、融资或负债、浮动利率计息负债的本息偿还进行套期保值；

（七） 深圳证券交易所认定的其他情形。

以签出期权或构成净签出期权的组合作为套期工具时，应当满足《企业会计准则第 24 号——套期会计》的相关规定。

第二章 证券投资、期货及衍生品交易的决策和管理

第七条 公司进行证券投资、期货及衍生品交易的决策权限：

（一） 证券投资：

1、 公司证券投资额度在公司最近一期经审计净资产 10%（含）以上且绝对金额超过 1000 万元人民币（含）的，由公司董事会批准；

2、 公司证券投资额度在公司最近一期经审计净资产 50%（含）以上且绝对金额超过 5000 万元人民币（含），由董事会审议后报股东会批准；

3、 公司证券投资单次或连续十二个月内累计金额未达到董事会审议标准的，由董事长审批。

上述投资金额以发生额作为计算标准，已按照规定履行相关义务的，不再纳入相关的累计计算范围。

公司因交易频次和时效要求等原因难以对每次证券投资履行审议程序和披露义务的，可以对未来十二个月内证券投资范围、额度及期限等进行合理预计。相关额度的使用期限不应超过十二个月，期限内任一时点的交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过证券投资额度。上市公司与关联人之间进行证券投资的，还应当以证券投资额度作为计算标准，适用公司章程涉及关联交易的相关规定。

（二） 期货及衍生品交易：

1、 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：

(1) 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，下同）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；

(2) 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；

(3) 公司从事不以套期保值为目的的期货和衍生品交易

2、 除应由股东会审议批准的期货与衍生品交易外，公司进行期货与衍生品交易均需提交董事会审议批准。

公司从事期货和衍生品交易，应当编制可行性分析报告并提交董事会审议。

公司因交易频次和时效要求等原因难以对每次期货和衍生品交易履行审议程序和披露义务的，可以对未来十二个月内期货和衍生品交易的范围、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十二个月，期限内任一时点的金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不应超过已审议额度。

第八条 公司从事证券投资应当分析证券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。

公司董事会应当持续跟踪证券投资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。

第九条 公司从事期货和衍生品交易的，应当合理配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员，指定审计委员会审查期货和衍生品交易的必要性及风险控制情况。

必要时可以聘请专业机构出具可行性分析报告。

公司应当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。

第十条 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 公司在证券投资、期货及衍生品交易有实际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）向董事长报告并同时知会董事会秘书，董事长立即向董事会报告。

第十二条 公司财务中心负责证券投资、期货及衍生品交易资金的筹集、使用管理，并负责对证券投资、期货及衍生品交易进行财务核算管理。

第十三条 公司审计监察部应当定期或不定期的对证券投资、期货及衍生品交易实施进展情况进行全面的监督和检查，认为证券投资、期货及衍生品交易过程中存在问题或违法违规情形的，应当及时向公司审计委员会提出异议或纠正意见，审计委员会接到报告后应当迅速查清事实，及时采取措施予以纠正或完善。

公司审计监察部负责对证券投资、期货及衍生品交易进行审计与监督，每个会计年度末应对所有证券投资、期货及衍生品交易进展情况进行全面检查，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，并向董事会审计委员会报告。

第三章 证券投资与衍生品交易的信息披露

第十四条 公司拟开展期货和衍生品交易时，应当披露交易目的、交易品种、交易工具、交易场所、预计动用的交易保证金和权利金上限、预计任一交易日持有的最高合约价值、专业人员配备情况等，并进行充分的风险提示。

第十五条 公司以套期保值为目的开展期货和衍生品交易的，应当明确说明拟使用的期货和衍生品合约的类别及其预期管理的风险敞口，明确两者是否存在相互风险对冲的经济关系，以及如何运用选定的期货和衍生品合约对相关风险敞

口进行套期保值。公司应当对套期保值预计可实现的效果进行说明，包括持续评估是否达到套期保值效果的计划举措。

第十六条 公司从事以投机为目的的期货和衍生品交易的，应当在公告标题和重要内容提示中真实、准确地披露交易目的，不得使用套期保值、风险管理等类似用语，不得以套期保值为名变相进行以投机为目的的期货和衍生品交易。

第十七条 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上市公司股东净利润的 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。

公司开展套期保值业务出现前款规定的亏损情形时，还应当重新评估套期关系的有效性，披露套期工具和被套期项目的公允价值或现金流量变动未按预期抵销的原因，并分别披露套期工具和被套期项目价值变动情况等。

第十八条 公司开展以套期保值为目的的期货和衍生品交易，在披露定期报告时，可以同时结合被套期项目情况对套期保值效果进行全面披露。套期保值业务不满足会计准则规定的套期会计适用条件或未适用套期会计核算，但能够通过期货和衍生品交易实现风险管理目标的，可以结合套期工具和被套期项目之间的关系等说明是否有效实现了预期风险管理目标。

第十九条 公司应按照中国证监会及深圳证券交易所的有关规定，及时披露公司开展证券投资、期货及衍生品交易业务的相关信息。

第四章 其他

第二十条 公司在调研、洽谈、评估证券投资、期货及衍生品交易时，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。因证券投资、期货及衍生品交易发生的违法违规行为，适用公司的劳动管理制度以及国家的法律法规处理。

第二十一条 公司控股子公司进行证券投资、期货及衍生品交易，视同上市公司的行为，适用本制度相关规定。公司参股公司进行证券投资、期货及衍生品交易，对公司业绩可能造成较大影响的，公司应当参照本制度相关规定，履行信息披露义务。

第五章 附则

第二十二条 本制度中“以上”均包含本数，“超过”不含本数。

第二十三条 本制度未尽事宜，按有关法律、法规和规范性文件及公司《章程》的规定执行。本制度如与国家日后颁布的法律、法规和规范性文件或经合法程序修改后的公司《章程》相冲突，按国家有关法律、法规和规范性文件及公司《章程》的规定执行，并立即修订该制度，报董事会审议通过。

第二十四条 本制度由公司董事会负责解释，自公司董事会审议通过之日起实施。

北京海兰信数据科技股份有限公司

二〇二六年十一月