



浙富控股集团股份有限公司  
证券投资、期货和衍生品交易管理制度

二〇二三年四月

## 第一章 总 则

**第一条** 为规范浙富控股集团股份有限公司（以下简称“公司”）的证券投资、期货和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《中华人民共和国公司法》《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》等有关法律、法规和规范性文件及《浙富控股集团股份有限公司章程》（下称“《公司章程》”）的规定，特制定本制度。

**第二条** 本制度适用于公司及其所属子公司（包括全资子公司和控股子公司）的证券投资、期货和衍生品交易行为。

**第三条** 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、委托理财以及深圳证券交易所认定的其他投资行为。其中，委托理财是指公司委托银行、信托、证券、基金、期货、保险资产管理机构、金融资产投资公司、私募基金管理人等专业理财机构对其财产进行投资和管理或者购买相关理财产品的行为。

本制度所称的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。

本制度所称的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。

以下情形不适用本制度证券投资、期货和衍生品交易的范围：

- （一）作为公司主营业务的证券投资、期货和衍生品交易行为；
- （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** 公司应当以本公司（或全资子公司和控股子公司）名义设立账户进行证券投资、期货和衍生品交易，不得使用他人账户或向他人提供资金进行证券投资、期货和衍生品交易。

**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、期货和衍生品交易。

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。

**第六条** 公司从事证券投资、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。

## 第二章 证券投资、期货和衍生品交易的决策权限

### 第七条 证券投资、期货和衍生品交易的决策权限：

#### （一）证券投资

1、公司证券投资总额占公司最近一期经审计净资产 10%以上且绝对金额超过 1000 万元人民币的，应当在投资之前经董事会审议通过并及时履行信息披露义务。

2、公司证券投资总额占公司最近一期经审计净资产 50%以上且绝对金额超过 5000万元人民币的，或者根据公司章程规定应当提交股东大会审议的，公司在投资之前除应当及时披露外，还应当提交股东大会审议。

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。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》及关联交易的相关规定。

#### （二）期货和衍生品交易

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，独立董事应当发表专项意见。

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大会审议：

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。

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。

### 第三章 证券投资、期货和衍生品交易的管理

**第八条** 公司董事长在董事会或股东大会授权范围内签署证券投资、期货和衍生品交易相关的协议、合同。董事长根据相关证券投资、期货和衍生品交易的投资类型指定相关部门对证券投资、期货和衍生品交易事项进行调研、洽谈、评估，执行具体操作事宜。

**第九条** 公司财务管理中心和期货部负责证券投资、期货和衍生品交易事项资金的筹集、使用管理，并负责对证券投资、期货和衍生品交易事项相关资金进行管理。

**第十条** 公司审计监察中心负责对证券投资、期货和衍生品交易事项的审计与监督，每半年应对所有证券投资、期货和衍生品交易事项进展情况进行全面检查，并根据谨慎性原则，合理地预计各项证券投资、期货和衍生品交易事项可能发生的收益和损失，并向审计委员会报告。对于不能达到预期效益的项目应当及时报告公司董事会。

**第十一条** 独立董事应就期货和衍生品交易事项的相关审批程序是否合规、内控程序是否建立健全、对公司的影响等事项发表独立意见。

**第十二条** 董事会秘书负责公司证券投资、期货和衍生品交易信息的对外公布，其他董事、监事、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证券投资、期货和衍生品交易信息。

### 第四章 证券投资、期货和衍生品交易的信息披露

**第十三条** 公司拟进行证券投资、期货和衍生品交易，应在董事会作出相关决议两个交易日内向深圳证券交易所提交以下文件：

- （一）董事会决议及公告；
- （二）独立董事就相关审批程序是否合规、内控程序是否健全及相关投资对公司的影响等事项发表的独立意见；
- （三）保荐人就该项投资的合规性、对公司的影响、可能存在的风险、公司采取的措施是否合理等事项进行核查，并出具明确的同意意见；（如有）
- （四）深圳证券交易所要求的其他资料。

**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** 公司董事会应当持续跟踪证券投资、期货和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。

**第十七条** 公司不得通过委托理财等投资的名义规避重大资产收购或者重大对外投资应当履行的审议程序和信息披露义务，或者变相为他人提供财务资助。

公司可对理财产品资金投向实施控制或者重大影响的，应当充分披露资金最终投向、涉及的交易对手方或者标的资产的详细情况，并充分揭示投资风险以及公司的应对措施。

**第十八条** 进行委托理财，公司发生以下情形之一的，应当及时披露相关进展情况和拟采取的应对措施：

- （一）理财产品募集失败、未能完成备案登记、提前终止、到期不能收回；
- （二）理财产品协议或相关担保合同主要条款变更；
- （三）受托方或资金使用方经营或财务状况出现重大风险事件；
- （四）其他可能会损害公司利益或具有重要影响的情形。

**第十九条** 公司应当在定期报告中对报告期内的证券投资和已经开展的期货和衍生品交易情况进行披露。

## 第五章 证券投资、期货和衍生品交易的责任追究

**第二十条** 凡违反相关法律法规、本制度及公司其他规定，致使公司遭受损失的，应视具体情况，给予相关责任人以处分，相关责任人应依法承担相应责任。

## 第六章 其他事项

**第二十一条** 本制度适用于公司、全资子公司、控股子公司的证券投资、期货和衍生品交易行为。未经公司同意，公司下属子公司不得进行证券投资、期货和衍生品交易。如子公司拟进行证券投资、期货和衍生品交易，应先将方案及相关材料报公司，在公司履行相关程序并获批准后方可由子公司实施。

**第二十二条** 本制度所称“以上”、“超过”均不含本数。

**第二十三条** 本制度规定的事项如与国家有关法律、法规、规范性文件及《公司章程》的规定相抵触，以国家有关法律、法规、规范性文件及《公司章程》的规定为准。

**第二十四条** 本制度由公司董事会负责解释。

**第二十五条** 本制度自公司股东大会批准之日起生效实施，原《证券投资和衍生品交易管理制度》自行废止。

浙富控股集团股份有限公司

二〇二三年四月二十九日