

佛山佛塑科技集团股份有限公司期货交易管理制度

(经 2014 年 3 月 13 日第八届董事会第七次会议审议通过修订)

第一条 目的：为规范佛山佛塑科技集团股份有限公司（以下简称“公司”）原材料期货交易行为，有效防范和化解经营风险，开拓新的采购和销售渠道，在从事期货交易活动时严禁投机。结合本公司实际情况，特制订本制度。

第二条 适用范围：根据实际情况，现阶段仅限于本企业正常生产所需的大宗原材料的期货交易；本制度适用于公司从事期货交易的部门和人员。

第三条 组织机构和职责：

3.1 成立以集团公司领导层为主的期货交易领导小组，组长由总裁担任，负责审批原材料期货交易计划。

3.2 成立风险控制小组，由监审部人员组成，组长由审计监察部负责人担任；负责监督、稽核期货交易计划实施情况，不定期对期货交易事宜进行审计，对期货业务管理进行合规检查，对相关协议、文件等进行法律审核，防范因违反国家法律法规、政策和公司内部管理制度而产生的风险。

3.3 成立财务小组，由财务部人员组成，组长由财务总监担任；参与编制期货交易计划，负责资金的汇划，安全、及时入账，风险预警、会计核算等。

3.4 成立交易小组，由供应链管理部人员组成，组长由供应链管理部负责人担任；根据批准的交易计划，负责制定具体的交易方案及执行交易指令、价格预测、单据收集传递工作，定期汇报期货交易状况。

第四条 参与期货方式：

4.1 公司拟对 PTA、PVC、LLDPE、PP 等品种进行塑料期货交易，期现结合套利操作。

4.2 根据市场趋势变化，调整优化库存仓位，尤其在整体市场处于低位时，而且期货低于现货时，或者在现货市场很难买入时，通过买入期货转移库存，减少资金占用，节约仓储成本。

4.3 期现套利，是期货市场和现货市场之间正常价格差距出现异常变化时进行对冲而获利，主要获利手段为正向市场套利，当现货价格比期货价格低，当期货价格减去现货价格的价差，高于套利成本的时候就出现了套利机会，根据持有的现货量，可以卖出不超过可用于交割现货量的远期期货，进行正向跨期套利；套利单建

仓后，首先，如果现货与远期期货的差价缩小，则按跨期套利的办法，直接在期货市场平仓了结，实现套利收益；其次，如果两者之间价差扩大，则通过实物交割完成交易，实现套利收益。

第五条 管理原则：

5.1 期货交易基本原则

5.1.1 公司的期货交易应遵守国家法律、法规。

5.1.2 公司的期货交易必须注重风险防范、保证资金运行安全。

5.2 内部控制制度

5.2.1 与期货公司订立的开户合同应按公司签订合同的有关规定及程序审核，并由公司董事长或董事长书面授权的人员签署。

5.2.2 交易授权制度。期货交易人员必须经过公司授权，授权应列明有权进行交易的人员名单、授权期限。被授权人只有在取得书面授权后方可进行授权范围内的操作。公司进行期货交易，必须执行严格的联合控制制度，即至少要有两名以上人员共同控制，且期货交易人员与资金、财务管理人员分离，相互制约。

5.2.3 交易信息通报制度。期货交易人员应定期编制期货报表，报告新建头寸状况、持仓状况、盈亏状况等基本内容，供应链管理部每月作月度结算表同时抄送财务部、监审部。

5.2.4 保密制度。期货交易相关人员必须对期货交易的一切信息、资料进行保密。

5.2.5 资料管理制度。供应链管理部对期货交易计划、交易原始资料、结算资料等业务档案至少保存7年。有关开户文件、授权文件等档案应至少保存15年。

5.3 期货交易流程

5.3.1 期货交易小组定期根据公司库存及现货销售的具体情况和市场价格行情，制定当月的期货交易计划书，财务小组根据资金情况协同编制，报经公司期货领导小组批准后方可执行。（期货交易计划书需在风险控制小组、财务小组备案。）

5.3.2 期货交易小组根据批准后的交易计划书，结合实际情况制定具体的交易操作方案(附表1)，经期货交易领导小组、财务小组、交易小组三名组长批准后执行。（操作方案需在风险控制小组、财务小组备案。）

5.3.3 期货交易小组填用款申请，经审批后，财务小组的资金调拨员根据操作

方案支付保证金并通知结算员。结算员根据公司的保证金情况和交易操作方案，确定交易头寸限额，并通知交易员。

5.3.4 交易员根据公司的交易操作方案选择合适的时机下达指令交易。每天交易结束后，交易员应及时将当日成交明细、结算情况向交易小组组长汇报，并把经纪公司发来的结算单交给交易小组组长和财务小组按制度归档。

5.3.5 财务部根据交易小组申请和期货帐户的盈亏情况，及时追加保证金。

5.3.6 每月的期货交易结束后，结算员及时将期货业务的相关汇总单证及交易总结交给财务小组，并向期货交易领导小组汇报。

5.3.7 公司根据实际情况，选择平仓或实物交割。如果需要进行实物交割了结期货头寸时，应提前对现货产品采购员、交易员及资金调拨员等相关各方进行妥善协调，以确保交割按期完成。

5.3.8 风险控制小组及财务小组根据各自的资料、情况向期货领导小组出具当月交易评估报告。

5.4 风险管理

5.4.1 风险管理与控制是首要任务，套利数量为不超过可用于交割的现货量。

5.4.2 坚持期现两个市场同时双向操作，禁止单边投机。

5.4.3 合理安排资金，防止资金链断裂。

5.4.4 风险控制小组必须相对独立运行，交易小组必须严格执行公司的期货交易风险控制制度。

5.5 账户管理

以“佛山佛塑科技集团股份有限公司”或公司的全资子公司名义设立期货保证金账户进行期货交易，不得使用除“佛山佛塑科技集团股份有限公司”或公司的全资子公司外的他人账户或向他人提供资金进行期货交易。

第六条 附则：

6.1 本制度未尽事宜，依照国家有关法律、法规、规范性文件以及本公司章程的有关规定执行。

6.2 本制度由供应链管理部负责解释。

6.3 本制度经公司董事会通过之日起实施。