

青岛汉缆股份有限公司

期货及衍生品管理制度

第一章 总则

第一条 为规范青岛汉缆股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）及子公司期货和衍生品交易行为，防范期货和衍生品交易风险，根据《中华人民共和国公司法》《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1号——主板上市公司规范运作》及《公司章程》的规定，制定本管理制度。

第二条 本管理制度适用于青岛汉缆股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）及所有子公司。

本制度所称套期保值业务，是为管理公司生产采购成本、实现预销售或规避存货跌价风险而通过境内外期货交易所或其他合法经营机构挂牌交易的期货合约、互换合约、远期合约、场内或场外期权等金融衍生品工具，达成相关品种的商品期货及衍生品交易；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。

第三条 公司进行期货及衍生品业务是利用期货市场和衍生品市场规避生产经营中的铜、铝原材料价格风险为目的，不得从事以投机为目的的期货和衍生品交易。

第四条 公司期货及衍生品业务应遵守以下基本原则：

- （一）进行期货业务只能进行场内市场交易，不得进行场外市场交易；
- （二）进行衍生品业务可以根据业务实际情况具体选择场内市场或场外市场；
- （三）进行期货、期权、衍生品业务的品种限于公司生产经营所需的铜、铝等有色金属原材料；

（四）公司进行期货保值的数量不得超过实际采购的数量，期货持仓量应不超过需要保值的数量；

（五）期货持仓时间应与保值所需的计价期相匹配；对于大宗订货合同，公司在签订现货合同后，相应的保值头寸持有时间不得超出合同规定的时间或该合同实际执行的时间；对于日常预期订货合同，公司应当根据过往历史记录和未来生产计划预计每个月现货采购量，相应的保值头寸持有时间不得超过该保值量下预计现货采购时间。

（六）公司应以公司名义设立套期保值交易账户，不得使用他人账户进行套期保值业务；

（七）根据期货交易所规定的期货业务保证金比例，参考公司需要进行期货业务的具体数量及期货平仓、交割业务的需求，公司用于套期保值的保证金资金规模应当与公司的原材料采购成本相匹配，且不得影响公司正常生产经营所需，公司不得使用募集资金直接或间接进行套期保值。

第二章 组织机构及职能分工

第五条 公司、各子公司从事期货和衍生品交易的，期货业务领导小组应当就期货或衍生品交易出具可行性分析报告并提交董事会审议。

第六条 公司董事会审计委员会负责审查期货及衍生品交易的必要性、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。董事会审计委员会应加强对期货及衍生品交易相关风险控制政策和程序的评价与监督，及时识别相关内部控制缺陷并采取补救措施。

第七条 公司用于期货或衍生品业务的金额达到《公司章程》《股东会议事规则》规定的股东会审议标准的，应当在公司董事会审议通过后提交股东会审议。

第八条 期货业务领导小组由公司总经理、采购副总经理、销售副总经理、财务总监和采购部长组成，公司总经理担任期货业务领导小组组长。

第九条 期货业务领导小组以会议形式进行期货及衍生品业务决策的实施，成员实行一人一票，须 2/3 以上赞成方可通过实施。期货业务领导小组会议由采购副总经理负责召集。

第十条 公司总经理或采购副总经理负责保值指令的下达和监督执行。

第十一条 公司采购部门负责期货及衍生品业务的具体执行，由采购部长和两名专职操作员负责依据指令完成开平仓或交割工作。各子公司进行期货及衍生品业务须将计划提交至公司本部采购部执行。任何分、子公司不得擅自从事期货及衍生品业务。

第十二条 公司销售部储运科负责交割货物的提货和运输。

第十三条 公司财务部负责调拨期货及衍生品业务所需资金，并监控账户资金流向及风险。

第十四条 公司成本中心负责对期货及衍生品业务的进行监督和考核。

第三章 期货及衍生品交易流程

第十五条 公司销售部门（含各分、子公司）的具体业务人员对于单笔金额在200万元以上且执行期在1个月之后的合同，应在接到中标通知书或合同签订次日9点前，编制好保值申请书向采购部提出保值申请，保值申请书的内容应包括合同、订单或中标通知书的编号、需要保值的材料品种、数量、中标价格、保值价格区间、交货期限等内容。保值申请单在提交前应得到公司总经理或其授权人员审批。具体交货期限不明确的，以招标文件要求的时间为准。

第十六条 在原材料价格大幅波动期间，为避免投标日至中标日期间原材料价格大幅波动风险，对于公司已报价投标的合同，应在报出投标书后次日9点前，编制好保值申请书向采购部提出保值申请，保值申请书的内容应包括合同、订单或中标通知书的编号、需要保值的材料品种、数量、中标价格、保值价格区间、交货期限等内容。具体交货期限不明确的，以招标文件要求的时间为准。

第十七条 除第十五条、第十六条规定的范围外，公司期货业务领导小组根据正常生产经营仍需使用的材料品种和数量情况，确定期货保值追加量。

第十八条 公司采购部门期货操作员依据保值申请书或期货业务领导小组确定的追加量，结合期货交易所价格走势，确保在保值价格区间内或更低价格进行保值操作。

第十九条 采购部门每周核对仓单数量，当持仓量小于相应月份的计划使用量且期货价格比现货价格有贴水时，可以差额量为限，向期货业务领导小组提出保值申请，经批准后择机进行保值。

第二十条 若因投标未能中标及正常生产经营所需材料未达之前预期，致使原材料现货库存量或期货持仓量超过实际原材料需要量时，为规避原材料价格大幅波动风险，经公司期货领导小组批准，公司可以在期货或现货市场将多余原材料卖出，严禁在无现货库存或期货持仓情形下进行卖空交易。具体操作量由期货领导小组确定。

第二十一条 公司采购部期货操作员根据交易账户资金占用情况，结合保值方案提出资金申请计划，由采购部长审核、总经理签字批准后报财务部。财务部审核并经财务总监签字确认后，将资金调拨至公司期货专用账户。

第二十二条 公司期货操作员在每天期货交易结束后，将当天的期货交易明细打印并存档，存档年限为三年。

第四章 风险控制

第二十三条 当期货价格波动超过3%时，期货操作员应在第一时间将情况向期货业务领导小组成员汇报，采购副总经理负责组织期货业务领导小组召开临时会议，研究对策。采购部长负责进行会议记录并将记录存档，存档期限为三年。期货操作员应列席会议，向期货业务领导小组汇报市场行情并提出专业意见或建议，供期货领导小组进行实施时作为参考。

第二十四条 公司应按照深圳证券交易所的相关规则履行信息披露义务。

第五章 其他

第二十五条 公司销售部门的具体业务人员如未依本制度第十五条、第十六条的规定按时提出保值申请的，每次扣罚 100 元并承担相应的经济责任。

第二十六条 公司采购部门期货操作员未按本制度第十八条的规定进行保的，按公司考核办法进行处理，造成损失的，应承担相应经济责任。

第二十七条 公司期货业务涉及的部门和人员，应严格按本制度规定执行，并自觉接受公司内审部或公司外聘的审计机构的审计。

第二十八条 公司期货业务相关信息，相关人员应严格保密。若因相关人员泄密造成损失的，应承担相应经济责任，公司可视具体情况给予开除或其他处分。

第二十九条 公司期货业务领导小组对期货经纪机构每年进行一次评审，经评审不合格的可进行更换。

第三十条 本制度由公司董事会审议通过生效，其修订、最终解释与考核权归公司董事会。

青岛汉缆股份有限公司

2026 年 2 月 6 日