宁波索宝蛋白科技股份有限公司

外汇衍生品交易业务管理制度

第一章　总则

第一条 为进一步加强宁波索宝蛋白科技股份有限公司（以下简称“公司”）外汇衍生品交易业务管理，防范投资风险，健全和完善公司外汇衍生品交易业务管理机制，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、规范性文件及《公司章程》等有关规定，并结合公司实际，制定本制度。

第二条 本制度所称外汇衍生品交易业务是指以公司正常的生产经营为基础，在金融机构办理的以防范和降低汇率或利率风险为目的的外汇衍生品交易业务，主要包括远期结售汇、外汇掉期、外汇期权、外汇互换、其他外汇衍生品交易业务等产品及上述产品的组合。

第三条 本制度适用于公司及子公司的外汇衍生品交易业务。

第二章 操作原则及要求

第四条 公司进行外汇衍生品交易业务遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不进行单纯以盈利为目的的外汇衍生品交易，所有外汇衍生品交易业务均以国际业务的收付外币情况为基础，以规避和防范汇率或利率风险为目的。

第五条 公司进行外汇衍生品交易业务只允许与经国家外汇管理局和中国人民银行批准、具有外汇衍生品交易业务经营资格的金融机

构进行交易，不得与前述金融机构之外的其他组织或个人进行交易。

第六条 公司需具有与外汇衍生品交易业务相匹配的自有资金，不得使用募集资金直接或间接进行外汇衍生品交易，且严格按照公司决策机构审议批准的外汇衍生品交易额度进行交易，不得影响公司正常生产经营。

第七条 公司必须以其自身名义或子公司名义设立外汇衍生品交易账户，不得使用他人账户进行外汇衍生品交易业务。

第八条 公司进行外汇衍生品交易业务必须基于公司外币收付汇规模及外币存贷款规模等预测情况，外汇衍生品交易合约的外币金额不得超过外币收付汇、外币存贷款等的预测金额。

第三章 授权及审批管理

第九条 公司开展外汇衍生品交易业务应当经公司董事会审议，达到本制度第十一条标准的提交股东会审议，公司开展外汇衍生品交易业务总体额度须在公司股东会或董事会批准额度内执行。未经公司股东会或董事会的批准，不得开展额外外汇衍生品交易业务。

第十条 公司开展外汇衍生品交易业务，应当编制可行性分析报告并提交董事会审议。

第十一条 公司开展外汇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、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 500 万元人民币；

（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的 50%以上，且绝对金额超过 5000 万元人民币；

（三）公司从事不以套期保值为目的的期货和衍生品交易。

股东会、董事会可授权董事长或董事长授权人在已审议通过的额度内决策具体事项，财务部负责外汇衍生品交易业务的具体操作实施。

第四章 部门职责及内部操作流程

第十二条 公司董事会和股东会是公司开展外汇衍生品交易业务的决策机构。按照《公司章程》和本制度规定的权限负责审批外汇衍生品交易业务的年度额度。

第十三条 相关责任部门及责任人：

（一）公司财务部：是外汇衍生品交易业务经办部门，负责外汇衍生品交易业务的日常运作和管理，负责方案拟订、资金筹集、业务操作、日常询价和联系及相关账务处理，在出现重大风险或可能出现重大风险时，及时向公司董事会和董事长提交分析报告和解决方案。

（二）内审部门：为外汇衍生品交易业务的内部审计监督部门，对外汇衍生品交易业务的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况、制度执行等工作进行监督检查。

（三）证券事务部：为公司外汇衍生品交易业务的信息披露部门，负责根据中国证监会、上海证券交易所的相关规定，履行外汇衍生品交易事项的董事会及股东会（如需）审批程序，并进行信息披露。

（四）独立董事、董事会审计委员会：有权对资金使用情况进行

监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

第十四条 外汇衍生品交易业务的内部操作流程：

（一）财务部以稳健为原则，以防范汇率和利率波动风险为目的，根据货币汇率和与外币银行借款相关的各种利率的变动趋势以及各金融机构报价信息，提出开展或中止外汇衍生品交易业务方案。

（二）董事长或董事长授权人负责审核财务部提交的交易方案，评估风险并在其权限范围内作出决策。

（三）财务部根据经过审批后的交易方案，与金融机构办理相关外汇衍生品交易手续。

（四）财务部应对每笔外汇衍生品业务交易进行登记，检查交易记录，及时跟踪交易变动状态，妥善安排交割资金，严格控制，杜绝交割违约风险的发生。

第五章 风险管理及内部报告制度

第十五条 财务部应当在董事会或股东会审议通过的额度内开展外汇衍生品交易业务，并根据与金融机构签署的交易合约中约定的外汇金额、汇率及交割期间，及时与金融机构进行结算。

第十六条 当汇率或利率发生剧烈波动时，财务部应及时进行分析，并将有关信息及解决方案及时报告董事长或董事长授权人。

第十七条 当公司外汇衍生品交易业务存在重大异常情况，并可能出现重大风险时，财务部应及时提交分析报告和解决方案，并随时跟踪业务进展情况；公司管理层应及时商讨应对措施，提出切实可行的解决方案，实现对风险的有效控制。内审部门应认真履行监督职能，

发现违规情况立即向董事会报告。

第六章 信息隔离措施

第十八条 参与公司外汇衍生品交易业务的所有人员须遵守公司的保密制度，未经允许不得泄露公司的外汇衍生品交易方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司外汇衍生品交易业务有关的信息。

第十九条 外汇衍生品交易业务交易操作环节相互独立，相关人员相互独立，不得由单人负责业务操作的全部流程。

第七章 外汇衍生品交易业务的信息披露

第二十条 公司开展外汇衍生品交易业务时，应按照中国证监会及上海证券交易所的相关规定，及时披露公司开展外汇衍生品交易业务的信息。

第二十一条 当公司外汇衍生品交易业务出现重大风险或可能出现重大风险，达到监管机构规定的披露标准时，公司应及时对外披露。

第八章 附则

第二十二条 本制度未尽事宜或与国家有关法律法规、规范性文件或《公司章程》存在冲突的，均按国家有关法律法规、规范性文件和《公司章程》的规定执行。

第二十三条 本制度由公司董事会制定并负责解释，自公司董事会审议通过之日起生效，修改亦同。

宁波索宝蛋白科技股份有限公司

2026 年 10 月