- 1 -
海南矿业股份有限公司
期货套期保值交易管理制度
（2022 年 11 月重新制定）

第一章 总则
第一条 为规范海南矿业股份有限公司（以下简称“公司”）境内外期货套期
保值交易，有效防范风险，维护公司利益，依据《中华人民共和国公司法》、《中
华人民共和国证券法》、《上市公司信息披露管理办法》、《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 1 号——规范运作》、《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》等法律法规、规
范性文件、《海南矿业股份有限公司章程》（以下简称“公司章程”）等有关规定，
结合公司实际情况，制定本制度。

第二条 公司应严格控制期货套期保值业务的品种及规模。从事的套期保值交
易品种仅限于与公司主要生产经营相关的产品或者所需的原材料，大宗商品及其货
币商品，套期保值的交易标的为境内外商品期货交易所或银行制定的标准化合约及
金融衍生品。公司从事期货套期保值业务的目的是为了防范和规避公司生产经营过
程中的原材料价格及汇率波动风险，保证公司产品成本和收益相对稳定，公司不得
进行投机交易。

第三条 公司以自身名义设立交易账户，不得使用其他账户操作期货套期保值
交易。

第四条 公司以自有资金进行期货套期保值交易，不得直接或间接使用银行信
贷资金及募集资金等不符合法律法规或中国证监会、上海证券交易所、境内外期货
交易所以及相关监管规定所禁止的资金进行期货套期保值交易。

第五条 公司开展期货套期保值交易须取得公司董事会或股东大会批准，并在

- 2 -
公司董事会或股东大会授权范围内严格按照操作流程进行。

第六条 本制度适用于公司及控股子公司，未履行本制度规定的相关审批程序，
公司及各控股子公司不得擅自开展套期保值业务。

第二章 组织机构及职责
第七条 公司董事会在权限范围内审议批准或提请股东大会审议批准公司年度
期货套期保值交易授权额度及其他与套期保值业务相关的重要事项。

第八条 公司成立期货套期保值业务领导小组（以下简称“领导小组”），领
导小组由总裁、联席总裁、业务分管副总裁、财务负责人、董事会秘书等组成。领
导小组主要负责落实相关制度；组建公司交易小组、结算小组、风控小组；在董事
会授权范围内决策并审批期货套期保值业务方案；组织贯彻实施套期保值业务方案；
协调处理公司套期保值业务重大事项等。包括：
（一）制定套期保值业务工作方针和原则，拟订公司套期保值业务相关制度并
提交公司董事会审议，审定公司套期保值管理工作的各项实施细则；
（二）监督和管理套༎颼ㄈ휄要Ȭ小组”

- 3 -
第十一条 交易小组主要负责根据市场行情情况和获批的具体交易方案组织落
实并执行期货交易；提出方案执行过程中的调整建议，并按程序向公司领导小组进
行报批；负责必要时的仓单注册交割等事项。包括：
（一）会同其他小组拟订期货套期保值业务方案，提交领导小组审批；根据领
导小组的决定，组织落实相关方案；
（二）按照要求发起决策流程及审批流程，在审批范围内执行套期保值交易方
案，负责公司套期保值业务的交易管理和日常交易风险控制，并对保证金账户使用
情况负责；
（三）交易小组应持续跟踪金融市场动态与套保商品期现货市场价格的变化，
根据市场变化情况，及时提出方案调整建议；
（四）负责向领导小组报告交易情况和执行效果；
（五）接受风控小组的监督、检查；
（六）完成领导小组布置的其他工作事项。

第十二条 结算小组由财务部主导，由财务部等相关部门人员担任资金调拨员、
会计核算员。主要负责公司套期保值业务的资金管理、会计处理、交易确认和交易
管理等事宜。
（一）资金调拨员：负责公司套期保值业务的资金调拨、使用监督和资金账户
的管理；根据经审批的套期保值交易方案及时完成资金调拨，保证实物交割和追加
保证金的及时完成。
（二）会计核算员：负责公司套期保值业务交易情况的确认和交易后的结算；
负责公司套期保值交易凭证的管理；按照会计准则的要求进行会计核算和账务处理。

第十三条 风控小组由公司审计部、战略管理部、证券法务部等相关部门人员
组成，主要职责包括：
（一）拟订套期保值业务有关风险管理办法及工作程序；会同审核套期保值交
易方案，呈报领导小组审批；
（二）监督交易小组和结算小组执行风险管理政策和风险管理工作程序；审查
期货交易相关业务记录，核查交易员的交易行为是否符合审批后的套保计划和交易

- 5 -
金、平仓方式、风险分析、风险控制措施、止损额度等。

第十七条 交易小组根据经领导小组批准的方案，发起审批流程，经相关部门
审批后方可执行。交易员根据获批的注入或追加保证金申请，交资金调拨员执行付
款。交易员应负责及时将收款通知单交由会计核算员进行相关帐务处理。交易员根
据公司的套期保值交易方案，选择合适的时机向经纪公司下达交易指令。

第十八条 风控小组核查交易是否符合审批情况，若不符合，须立即报告领导
小组。

 Nþ×?4ôhÔC_
V

- 6 -
述标准的，应根据公司章程及公司年度经营目标与风险容忍度等，由公司董事会或
股东大会进行审批授权。

第二十三条 公司在套期保值交易方案中需明确止损策略，同时须根据实际经
营情况制定套期保值年度止损限额。在持有头寸接近亏损时，交易小组须高度关注
并及时告知

-
7
-
（一）当发生属经纪公司或交易所过错的错单时：由交易员通知经纪公司或交
易所，并由经纪公司或交易所及时采取相应错单处理措施，再向经纪公司或交易所
追偿产生的直接损失；
（二）当发生属于公司交易员过错的错单时，须立即向风控小组报告，再由交
易员采取相应的指令，相应的交易指令要求能消除或尽可能减小错单对公司造成的
损失。
第二十八条 公司应妥善选择经纪公司，防范法律风险；妥善选择交易合约月
份、交割期等，避免市场流动性风险；密切注意不同交割期合约之间的基差变化，
防范基差风险；合理安排信用额度与保证金，保证套期保值过程正常进行。
第二十九条 应严格按照有关规定安排和任用期货套期保值业务相关工作人
员，加强人员的职业道德教育及业务培训，提高人员的综合素质。
第三十条 执行期货套期保值交易方案时，如遇国家政策、市场发生重大变
化等原因，导致继续进行该业务将造成风险显著增加、可能引发重大损失时，风控
小组应及时主动向领导小组报告相关风险。
第三十一条 套期保值交易的交易原始资料、结算资料等业务档案至少保存
5
年，套期保值交易开户文件、授权文件等档案应至少保存 10 年。
第三十二条 从事套期保值交易的相关人员不得擅自泄露本公司的套期保值交
易方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司套期保值交易有关的信息。 第三十Ҝ条 公司应षㄦ合要≴ⲱᣑ算㗶、᣺㗶、交易㗶ৱ�关 ऴ˂؇ᵄ㗀䵁쐴ᔅ謡錔挕〨弁쐀 第三十킛条 ଡ픍恐ꀫ䁥讶쀀ᣓ算ൢ及䐵脵솷哌쁖꼄퐜䌄㍲눙ㅆ葠돧㋋䀬耀公司应及时⭐鍰⭑섏㻳堓屠《ㆱḁ햻滰㐓ថऴ或

- 9 -
执行。
第四十一条 本制度经公司股东大会审议通过之日生效，修改时亦同。

第四十二条 本制度的解释权属于公司董事会。