

浙江苏泊尔股份有限公司

境内期货投资内部控制制度

第一章 总则

第一条 为规范期货交易监管流程，防范交易风险，实现对公司铝锭、铜、钢材等大宗原材料采购价格的锁定，确保公司金融资产安全，特制定本制度。

第二条 公司的期货投资业务只限于与公司生产经营产品或所需的原材料相关期货品种，目的是充分利用期货市场的套期保值功能，减少公司生产所需的主要原材料因价格波动造成的损失。

第三条 公司董事会授权董事长组织建立公司期货领导小组，作为管理公司期货的最高决策机构。

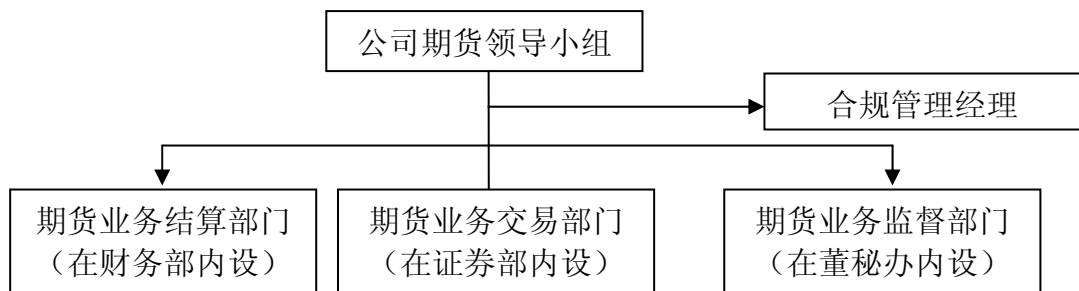
全年期货现金投资额度不得超过 3000 万元，占用保证金不超过 2000 万元。如果超过，则须上报公司董事会，由公司董事会根据公司章程及有关内控制度的规定进行审批后，及时召开股东大会获得股东大会的授权。

第四条 公司根据实际需要对管理制度进行审查和修订，确保制度能够适应实际运作和新的风险控制需要。

第五条 公司的期货投资业务管理制度应传达到每位相关人员，每位相关人员应理解并严格贯彻执行本管理制度。

第二章 组织机构

第六条 公司的期货投资业务组织机构设置如下：



第七条 期货领导小组的职责为：

- （一）负责对公司从事期货套期投资业务进行监督管理。
- （二）负责召开期货领导小组会议，制订期货年度投资计划，并提交董事会审议。
- （三）听取小组下设办事机构的工作报告，批准授权范围内的期货投资交易方案。
- （四）负责审定公司期货投资管理工作的各项具体规章制度，决定工作原则和方针。
- （五）负责交易风险的应急处理。
- （六）负责向董事会提交年度报告和下年度期货投资工作计划。

第八条 期货投资领导小组下设交易员、档案管理员、资金调拨员、会计核算员、风险控制员和合规管理经理岗位。各岗位职责权限如下：

- （一）交易员：由证券部设置，负责监控市场行情、识别和评估市场风险、制订期货投资交易方案、执行交易指令、对已成交的交易进行跟踪和管理等；
- （二）档案管理员：由证券部、股份公司财务部设置，负责期货投资资料管理，包括期货投资计划、交易方案、交易原始资料、结算资料等。证券部负责管理期货投资计划与交易方案，其他由股份公司财务部管理；
- （三）资金调拨员：由股份公司财务部设置，根据交易记录完成收付款；
- （四）会计核算员：由股份公司财务部设置，相关帐务处理等财务结算工作；
- （五）风险控制员：由董秘办设置，负责每月定期对月度期货交易的执行情况进行监督，并直接向期货领导小组汇报风险控制工作。
- （六）合规管理经理：由内部审计经理担任，负责每月定期对月度对期货业务相关人员对相关政策法规执行情况、对公司内部有关规章制度的执行情况进行监督，并直接向期货领导小组汇报内控制度执行情况。

第九条 期货投资小组各岗位人员应有效分离，不得交叉或越权行使其职责，确保能够相互监督制约。

第三章 授权制度

第十条 公司董事会授权期货领导小组决定期货投资的具体工作进程、进行

期货投资业务的管理工作。

与经纪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后，由公司法定代表人或经法定代表人授权的人员签署。

第十一条 公司对期货交易操作实行授权管理。交易授权书应列明有交易的人员名单、可从事交易的具体种类和交易限额；期货交易授权书由公司期货领导小组负责人签署。

第十二条 被授权人员只有在取得书面授权后方可进行授权范围内的操作。

第十三条 如因各种原因造成被授权人的变动，应立即由授权人通知业务相关各方。被授权人自通知之时起，不再享有被授权的一切权利。

第四章 业务流程

第十四条 各生产基地根据公司成本核算提报原材料保值需求，填报《原材料保值审批表》，事业部总经理签字批准，并由交易员制定原材料保值方案，报期货领导小组审核，经批准后方可执行。交易方案应包括以下内容：保值交易的建仓品种、价位区间、数量、拟投入的保证金、风险分析、风险控制措施、止损区间等。

第十五条 交易员根据批准的方案，填写注入或追加保证金的付款通知，经财务部相关主管审批同意后交资金调拨员执行付款。会计核算员根据银行的单据进行帐务处理。交易员根据公司的期货投资方案向期货经纪公司下达交易指令。

第十六条 交易结束后，交易员应及时将期货经纪公司交易系统生成的交易账单传递给风险控制员进行审核。

第十七条 风险控制员核查交易是否符合原材料保值方案，若不符合，须立即报告公司期货领导小组。

第十八条 会计核算员每月末收到交割单或结算单并审核无误，并经财务部相关主管签字同意后，进行帐务处理，并与交易员核对保证金余额。

第五章 风险管理制度

第十九条 风险控制员须严格审核公司的期货投资是否为公司生产所需的主要原料（铜、铝、钢材等）进行的保值，若不是，则须立即报告公司期货领导小

组。

第二十条 应严格按照公司董事会的决议执行，期货投资的数量原则上不得超过全年实际采购需求量，期货持仓时间原则上应与生产经营保值所需的时间相匹配。

第二十一条 公司建立以下内部风险报告制度和风险处理程序：

（一）内部风险报告制度：

1、当市场价格波动较大或发生异常波动的情况时，交易员应立即报告风险管理员；并同时上报公司期货领导小组。

2、当发生以下情况时，风险控制员应立即向公司期货领导小组报告：

- （1）期货业务有关人员违反风险管理政策和风险管理工作程序；
- （2）经纪公司的资信情况不符合公司的要求；
- （3）公司的具体保值方案不符合有关规定；
- （4）交易员的交易行为不符合期货投资方案；
- （5）公司期货头寸的风险状况影响到期货投资过程的正常进行；
- （6）公司期货业务出现或将出现有关的法律风险。

（二）风险处理程序：

1、公司期货领导小组负责人及时召集公司“期货领导小组”成员和有关人员，召开会议分析讨论风险情况及应采取的对策；

2、相关人员执行公司的风险处理决定。

第六章 报告制度

第二十二条 交易员应每日汇总当天新建头寸情况、汇总持仓状况、结算盈亏状况、保证金使用状况、计划建仓及平仓头寸情况及最新市场信息等情况，并将上述情况每月进行总结，向风险控制员和合规管理经理递交总结报告。

第二十三条 风险控制员和合规管理经理应每月定期向公司期货领导小组报告期货业务的操作情况及相关人员对相关法律法规政策执行情况、对公司内部有关规章制度的执行情况等。

第七章 档案管理制度

第二十四条 公司对期货投资的交易原始资料、结算资料等业务档案保存至少 15 年。

第二十五条 公司对期货业务开户文件、授权文件等档案应保存至少 15 年。

第八章 保密制度

第二十六条 公司期货业务相关人员应遵守公司的保密制度。

第二十七条 公司期货业务相关人员未经允许不得泄露本公司的期货投资方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司期货交易有关的信息。

第九章 附则

第二十八条 本制度自公司董事会审议通过后施行。

第二十九条 本制度由公司董事会负责解释。

浙江苏泊尔股份有限公司董事会

二〇一〇年八月