

深圳市兆驰股份有限公司

金融衍生品交易内部控制制度

第一章 总 则

第一条 为规范深圳市兆驰股份有限公司（简称“公司”）及各控股子公司（以下简称“各子公司”）金融衍生品交易行为，防范金融衍生品交易风险，根据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》等有关法律、法规、部门规章及《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 本制度所称金融衍生品是指场内场外交易、或者非交易的，实质为期货、期权、远期、互换等产品或上述产品的组合。金融衍生品的基础资产既包括证券、指数、利率、汇率、货币、商品、其他标的，也可包括上述基础资产的组合；既可采取实物交割，也可采取现金差价结算；既可采用保证金或担保、抵押进行杠杆交易，也可采用无担保、无抵押的信用交易。

第三条 本制度适用于公司及控股子公司的金融衍生品交易业务。控股子公司进行金融衍生品交易业务视同公司金融衍生品交易业务，适用本制度。但未经公司同意，公司下属控股子公司不得操作该业务。

第二章 金融衍生品交易业务操作原则

第四条 公司不进行单纯以盈利为目的的外汇交易，所有金融衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率风险为目的。

第五条 公司及各子公司进行金融衍生品业务只允许与经国家外汇管理局和中国人民银行等监管机构或是所在国家及地区金融外汇管理当局批准、具有相关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。各子公司金融衍生品交易应控制资金规模，不得影响公司的正常生

产经营。

第六条 公司必须以其自身名义或控股子公司名义设立金融衍生品交易账户，不得使用他人账户进行金融衍生品交易业务。

第三章 金融衍生品交易业务的审批权限

第七条 公司董事会或股东大会为金融衍生品交易的审批机构，但公司所有金融衍生品投资均需提交董事会审议。

（一）公司从事金融衍生品交易，管理层应当就金融衍生品交易出具可行性分析报告并提交董事会，经公司董事会审议通过、独立董事发表专项意见后，方可执行。

（二）对超出董事会权限范围并且不以套期保值为目的的金融衍生品交易，经公司董事会审议通过、独立董事发表专项意见，提交股东大会审议通过后，方可执行。

在发出股东大会通知前，公司应当自行或聘请咨询机构对拟从事的金融衍生品交易的必要性、可行性及金融衍生品风险管理措施出具专项分析报告并披露分析结论。

（三）公司与关联方之间进行的金融衍生品关联交易，应提交股东大会审议后并予以公告。

第八条 公司资金管理部可对金融衍生品交易的投资范围、投资额度及期限等进行合理预计，以额度金额为标准提交公司董事会审议。

相关额度的使用期限不得超过 12 个月，期限内任一时点的证券投资与衍生品交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不得超过投资额度。

第九条 公司董事会授权财务总监负责金融衍生品交易业务的运作和管理，并负责签署相关协议及文件。

第四章 金融衍生品交易业务的管理及内部操作流程

第十条 公司金融衍生品交易业务的部门职责及责任人：

（一）资金管理部：部负责评估金融衍生品的交易风险，分析金融衍生品交易的可行性与必要性，编制金融衍生品可行性分析报告并及时上报突发事件及风险评估变化情况。金融衍生品可行性分析报告包括交易品种和额度，金融衍生品交易的可行性、必要性及风险控制等内容。财务总监为交易第一责任人。

（二）审计部：公司审计部为公司金融衍生品交易的监督部门，负责对公司及各子公司金融衍生品交易决策、管理、执行等工作进行合规性进行监督检查；负责分析公司及各子公司的经营状况、事业计划完成情况等，并以此为依据对金融衍生品交易必要性提出审核意见，并根据管理要求及时提供损益分析数据及风险分析。审计部负责人为监督义务的第一责任人。

第十一条 公司根据证监会、深圳证券交易所等证券监督管理部门的相关要求，由董事会秘书负责审核金融衍生品交易业务决策程序的合法合规性并及时在相关临时报告或定期报告中予以披露。

第十二条 公司从事金融衍生品交易业务的人员应当具备良好的职业道德，具有金融、投资、财务、法律等方面的专业知识。

第五章 信息隔离措施

第十三条 金融衍生品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，并由公司审计部负责监督。

第十四条 参与公司金融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金融衍生品交易方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司金融衍生品交易有关的信息。

第六章 内部风险控制制度

第十五条 在金融衍生品业务操作过程中，财务部应根据与金融机构签署的金融衍生品合约中约定的标的资产金额及交割期间，及时与金融机构进行结算。

第十六条 当标的资产价格发生剧烈波动时，资金管理部应及时进行分析，并将有关信息及时上报。

第十七条 当公司金融衍生品业务出现重大风险或可能出现重大风险，资金管理部应及时向财务总监提交分析报告和解决方案，并同时向公司董事会秘书报告。董事会秘书根据有关规定提交公司董事会或股东大会审议。已出现或可能出现的重大风险达到中国证券监督机构规定的披露标准时，公司按有关规定应及时公告。

第十八条 公司审计部对前述内部控制制度的实际执行情况进行监督。

第七章 附 则

第十九条 本制度未尽事宜，公司应当依照有关法律、法规、规范性文件及公司章程的规定执行。本制度如与法律、法规或公司章程相抵触，应按国家有关法律、法规及公司章程的规定执行。

第二十条 本制度经公司董事会审议通过后生效。

第二十一条 本制度由公司董事会负责解释。

第二十二条 公司于 2011 年 5 月公布的《远期外汇套期保值业务内部控制制度》废止。

深圳市兆驰股份有限公司

董 事 会

二〇二〇年八月二十五日