

# 千禾味业食品股份有限公司

## 期货套期保值业务管理制度

### 第一章 总则

第一条 为规范千禾味业食品股份有限公司（以下简称“公司”）期货套期保值业务（以下简称“套保业务”），防范交易风险，确保套保业务有序进行，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》及《千禾味业食品股份有限公司章程》（以下简称“《公司章程》”）等有关规定，结合公司实际情况，特制订本制度。

第二条 本制度适用于公司及全体子公司。

第三条 公司进行套保业务的期货品种仅限于与公司生产经营相关的产品或者所需的原材料。以保证原材料供应、公司正常生产为前提，以规避生产经营中的商品价格风险为目的。公司不得进行以投机为目的的交易。

第四条 公司从事套保业务，应遵循以下原则：

（一）公司在进行套保业务时，应严格遵守相关法律、法规和规范性文件与期货交易的规定，不得进行违法违规的交易；

（二）公司进行套保业务，只能在依法经过批准或者核准，具有衍生品交易业务经营资格的机构进行。

第五条 从事套保业务的资金来源于公司生产经营过程中积累的自有资金。不得使用募集资金直接或间接进行套保业务。套保业务所使用的资金不得超过董事会授权的资金额度。

第六条 套保业务账户须以公司或子公司名义开立，公司不得使用他人账户或向他人提供资金进行套保业务。

## 第二章 组织机构与职责

第七条 在股东会授权范围内，董事会核准套保业务年度计划，包括投资规模、期限等，董事会持续跟踪套保业务年度计划的执行进展和投资安全状况，如出现投资发生较大损失等异常情况的，立即采取措施并按规定履行披露义务。

第八条 公司设立“期货套期保值业务领导小组”（以下简称“领导小组”），管理公司套保业务。领导小组由公司董事长、副总裁、财务总监、董事会秘书、审计部长组成，董事会授权董事长主管公司套保业务，担任领导小组组长。领导小组成员按分工负责套保业务相关事务的审批、监督及披露。

第九条 公司采购部设期货交易员负责套保业务的实施。

第十条 公司财务部负责确保经批准的用于套保业务的资金筹集与使用监督。

第十一条 公司审计部负责定期不定期审查套保业务的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况。

第十二条 公司董事会办公室负责根据有关法律法规对套保业务的情况进行披露。

## 第三章 审批权限

第十三条 公司进行套保业务须经董事会批准，公司应当就套保业务制定可行性分析报告，提交董事会审议并及时履行信息披露义务，属于下列情形之一的，还应当提交股东会审议：

（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 30%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 30%以上，且绝对金额超过 5,000 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。

第十四条 公司因交易频次和时效要求等原因难以对每次期货和衍生品交易履行审议程序和披露义务的，可以对未来 12 个月内期货和衍生品交易的范围、

额度及期限等进行合理预计并审议。相关额度的使用期限不应超过 12 个月，期限内任一时点的金额（含使用前述交易的收益进行交易的相关金额）不应超过已审议额度。

## **第四章 业务流程**

第十五条 领导小组成员应当在董事会授权范围内，结合公司经营需要和市场价格行情等，拟订套保业务方案，经领导小组组长批准后实施。

第十六条 根据套保业务方案，期货交易员提交注入或追加保证金的付款通知，根据公司相关资金审批制度规定审批同意后执行付款，并且跟踪资金风险状况。资金划拨按公司资金操作流程处理。期货交易员应根据套保业务方案下达交易指令，成交确认后，期货交易员应向期货领导小组及时报告交易情况。

第十七条 期货交易员应每个交易日适时跟踪持仓情况并报告期货领导小组。由领导小组组长做出平仓决定，包括平仓时间、价位区间等。

第十八条 交易员按公司会计核算的相关规定及时将套保业务的相关汇总单或凭证传递到财务部。财务部收到交割单或结算单并审核无误，经相关负责人签字同意后进行账务处理。会计核算员每月末与交易员核对保证金余额。

## **第五章 风险管理**

第十九条 公司应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，期货交易员应立即报告领导小组，领导小组及时研究并提出解决方案，解决方案经领导小组组长批准后执行；

2、公司审计部负责操作风险的监控，当发生以下情况时，应立即向领导小组报告：（1）期货经纪公司的资信情况不符合公司的要求；（2）公司的具体套保业务方案不符合有关法律法规规定；（3）公司期货交易人员的交易行为不符合套保业务方案；（4）公司期货头寸的风险状况影响到套保业务的正常进行；（5）公司套保业务出现或将出现有关的法律风险。

(二) 风险处理程序：

- 1、工作小组应及时召开会议，分析讨论风险情况及应采取的风险处理方案；
- 2、风险处理方案经领导小组批准后，相关人员及时按风险处理方案执行。

第二十条 公司在开展套保业务前须做到：

(一) 慎重选择期货经纪公司；

(二) 各套保业务相关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；

(三) 公司从事套保业务人员应具备下列条件：

- 1、期货专业知识及管理经验、有良好的职业道德；
- 2、有较高的业务技能，熟悉期货交易相关的法律、法规，遵守法律、法规及期货交易的各项规章制度，规范自身行为，杜绝违法、违规行为。

## **第六章 保密**

第二十一条 公司套保业务相关人员须遵守公司的保密制度。

第二十二条 公司套保业务相关人员未经允许不得泄露公司的套保业务方案、交易情况、结算情况、资金状况等与公司套保业务有关的信息。

## **第七章 档案管理**

第二十三条 套保业务相关开户文件、批准或审批文件、交易原始记录、结算资料等业务档案保存至少 15 年以上。

## **第八章 附则**

第二十四条 本制度未尽事宜，依照国家有关法律、法规及其他规范性文件的规定执行。本制度如与日后颁布的有关法律、法规、规范性文件的规定相抵触，按有关法律、法规、规范性文件的规定执行，并由董事会及时修订。

第二十五条 本制度由公司董事会制定及解释，经公司董事会审议通过后生效并实施，修订时亦同。

千禾味业食品股份有限公司

2025 年 12 月