



HUQQICAPITALCO LEDINCHINA

华旗资本（中国）有限公司

（于香港注册成立有限公司）

华旗资本中有限公司衍生品投资管理制度

- 第一条 为规范连华旗资本中国有限公司(下称“公司”)衍生品投资行为,控制衍生品投资风险,根据《公司法》、等法律、行政法规、部门规章和业务规则以及《公司章程》的有关规定,制定本制度。
- 第二条 本制度所称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。衍生品的基础资产既可包括证券、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 公司自身不进行衍生品投资,公司子公司经相应的程序可以进行衍生品投资。
- 第四条 公司子公司进行衍生品投资前,应当制定衍生品投资的管理制度。
- 第五条 公司子公司在进行衍生品投资前,应当根据会计准则的规定,确定衍生品投资的计量及核算方法。
- 第六条 公司子公司在进行衍生品投资前,要评估衍生品投资的风险,分析衍生品投资的可行性与必要性,形成可行性报告和专项分析报告。
- 第七条 公司子公司在进行衍生品投资前,要按照子公司章程和相关管理制度的规定,履行必要的审批程序。
- 第八条 公司子公司已投资衍生品的公允价值减值与用于风险对冲的资产价值变动加总。
- 第九条 对开展衍生品投资的相关信息,公司应按照公司法的相关规定在临时报告或者定期报告中予以披露。
- 第十条 公司子公司应于每个月结束后 10 日内、向公司管理层和董事会提交当月的衍生品投资分析报告。报告内容应包括衍生品投资授权执行情况、已开展的衍生品业务的风险敞口变化情况、风险评估结果、衍生品投资盈亏状况、止损限额执行情况等。
- 第十一条 本制度未尽事宜,或者与有关法律、法规、规章、规范性文件等规定相抵触的,应当依照有关规定执行。

特此公告。

华旗资本（中国）有限公司

董事会

2016年9月9日

