

陕西省国际信托股份有限公司 自有资金证券投资业务管理办法

(本办法经 2015 年 12 月 18 日第 27 次总裁办公会议审议通过, 于 2016 年 7 月 15 日印发执行)

第一章 总则

第一条 为规范公司固有业务项下证券投资业务, 有效防范证券投资业务风险, 提高证券投资业务盈利水平, 根据《证券法》、《公司章程》等相关制度, 并结合公司实际情况, 特制定本办法。

第二条 本办法所称证券投资业务指公司使用自有资金, 在合法的证券交易场所买卖股票、债券等公开挂牌的证券品种, 以及购买公募基金的证券投资行为。定向增发等非日常性证券投资业务, 参照固有业务评审决策和投资办法执行。

第三条 证券投资业务的原则:

(一) 合法合规原则。证券投资活动必须遵守国家法律法规及公司的有关规章制度。

(二) 明确分工、严格监管的原则。

(三) 在有效控制风险的前提下, 力求长期稳定收益。

第二章 实施机构和职责

第四条 投资管理总部在公司年度证券投资计划授权额度内, 决策和实施日常证券投资交易, 其基本职责是:

(一) 负责经营和管理公司自有资金证券投资业务。

(二) 制订年度证券投资计划, 实施投资方案, 包括决定投资品种、实施证券买卖等, 并报请公司相关权力机构审议。

(三) 组织证券投资分析和项目调研, 编制投资建议报告书。定期或不定期向公司领导报告证券投资业务开展情况。

(四) 执行证券账户及资金管理的有关规定, 确保账户和资金的安全。

第五条 投资管理总部根据业务开展需要设置投资经理、研究员、交易员岗位。

(一) 投资经理的基本职责: 根据公司年度证券投资计划确定的投资原则、范围、策略, 拟定证券投资组合方案; 负责跟踪持仓股票基本面情况的变化; 撰写月度证券投资总结。

(二) 研究员的基本职责: 对证券市场发展趋势进行预测, 对行业和个股基本面进行研究, 就公司证券投资策略和投资组合提出建议。

(三) 交易员的基本职责: 按照部门总经理和投资经理下达的交易指令进行操作; 编制证券交易统计报表; 负责保管交易指令。

第六条 证券交易的操作流程:

(一) 投资经理按照经部门总经理同意的证券投资组合方案, 向交易员下达书面交易指令。

(二) 交易员按照交易指令确定的买卖股票的品种、价格、数量、时间等要素, 完成股票买卖。

(三) 交易员在当天收市后应及时整理交易指令执行情况, 并估算当天交易成本和证券余额变动情况, 向投资经理、部门总经理等有关人员提交证券市场交易投资状况统计表。

第七条 在证券投资交易过程中, 发生以下情形的, 投资管理总部应及时向分管领导进行汇报:

(一) 根据市场变化情况，对证券投资组合方案进行动态调整。

(二) 按照证券投资组合方案进行投资交易，对持仓品种进行大范围调仓。

第八条 投资管理总部每月初对上月的操作情况总结，对持仓品种、市值变化等情况进行说明，分析证券市场走势，预判市场后期发展方向，提出重点关注行业、品种等，并拟定下月证券投资组合方案。月度总结通过OA 报送分管领导、总裁、董事长。

第三章 账户及核算管理

第九条 公司应以本公司名义设立证券账户和资金账户进行证券投资，不得使用他人账户或向他人提供资金进行证券投资。

第十条 证券投资账户的开户、转户、销户需经总裁批准。开户券商原则上应选择中国证券业协会审核的创新类或规范类券商。

第十一条 证券投资的资金划拨程序须严格遵守公司财务管理制度。

第十二条 计划财务部负责对公司证券投资业务进行账务核算，投资管理总部需将证券买卖等原始单据或记录及时递交计划财务部。

第四章 风险控制

第十三条 自有资金投资证券二级市场，应遵循以下风险控制措施：

(一) 禁止买卖本公司股票。

(二) 原则上不得投资ST、*ST 股，除非有确切证据表明该公司已经摆脱经营困难或重组成功。

(三) 单个项目总投资不得超过该股票总股本的5%。

(四) 单个项目投资额不得超过年度证券投资计划额度的30%。

第十四条 投资管理总部实施证券投资业务的人员应当岗位分离，从事具体投资操作与资金划转业务的，应由不同岗位人员组成。证券投资资金密码和证券交易密码分人保管，并应定期更换。

第十五条 投资管理总部应完整记录证券投资过程中的各种业务指令及执行情况，并妥善保管。

第十六条 当个股浮盈达到50%时，原则上应卖出当前持股数量的30%；当个股浮盈达到100%时，原则上应卖出当前持股数量的50%。当收盘后个股浮亏超过20%时，原则上应实施止损操作。

第十七条 投资管理总部要经常对内部工作流程执行情况和各种业务指令进行监控、检查，发现问题及时处理。

第十八条 计划财务部每季度初应与投资管理总部核对股票数量、资金账户余额等。

第十九条 监察审计部定期或不定期对证券投资业务情况进行审计。

第五章 保密制度

第二十条 公司证券投资业务为特殊业务，属于公司机密。知悉情况的人员应严格保守秘密。

第二十一条 除业务需要外，未经分管领导批准，公司任何部门不得以任何理由要求查询证券账户上的交易记录。

第二十二条 证券投资业务从业人员应恪守职业道德，不得向公司内外无关人员透露有关交易信息。对交易操作记录簿、交易台账、交易报表等涉及证券交易情况的文件和资料，应妥善保管。

第二十三条 公司知悉证券投资持仓品种的人员不得利用该内幕信息买卖相应股票。

第六章 审批权限和信息披露

第二十四条 公司证券投资业务审批权限依据《董事会议事规则》、《股东大会议事规则》、《公司章程》有关规定执行，并履行相应的信息披露义务。

第二十五条 公司进行证券投资应遵照《深圳证券交易所上市公司信息披露工作指引第 4 号-证券投资》、《深圳证券交易所上市公司信息披露业务备忘录第 25 号-证券投资》等有关规定在定期报告中披露报告期内证券投资以及相应的损益情况。

第七章 罚则

第二十六条 违反本办法给公司造成损失的，公司将视情节按照相关管理制度追究责任人责任。

第八章 附则

第二十七条 本办法经2015 年12月18日第27次总裁办公会议审议通过，自印发之日起执行。《自有资金证券投资业务管理办法》（[2013]30号）自动废止。