



LUZHENG FUTURES COMPANY LIMITED
魯証期貨股份有限公司

(於中華人民共和國註冊成立之股份有限公司)
(股份代號：01461)



2017

環境、社會及管治報告



本環境、社會及管治報告(「本報告」)是根據香港聯合交易所有限公司發佈的《香港聯合交易所有限公司證券上市規則》附錄二十七之《環境、社會及管治報告指引》，披露魯証期貨股份有限公司(「本公司」，連同本公司附屬公司統稱「本集團」)自2017年1月1日起至2017年12月31日止期間(「報告期」)於中華人民共和國(「中國」)的業務運營中，在環境、社會及企業管治方面的相關舉措及表現。

本集團主營業務範圍包括商品期貨經紀、金融期貨經紀、期貨投資諮詢、期貨資產管理、商品貿易、登記和結算服務，及中國證券監督管理委員會(「中國證監會」)允許之其他業務活動等。

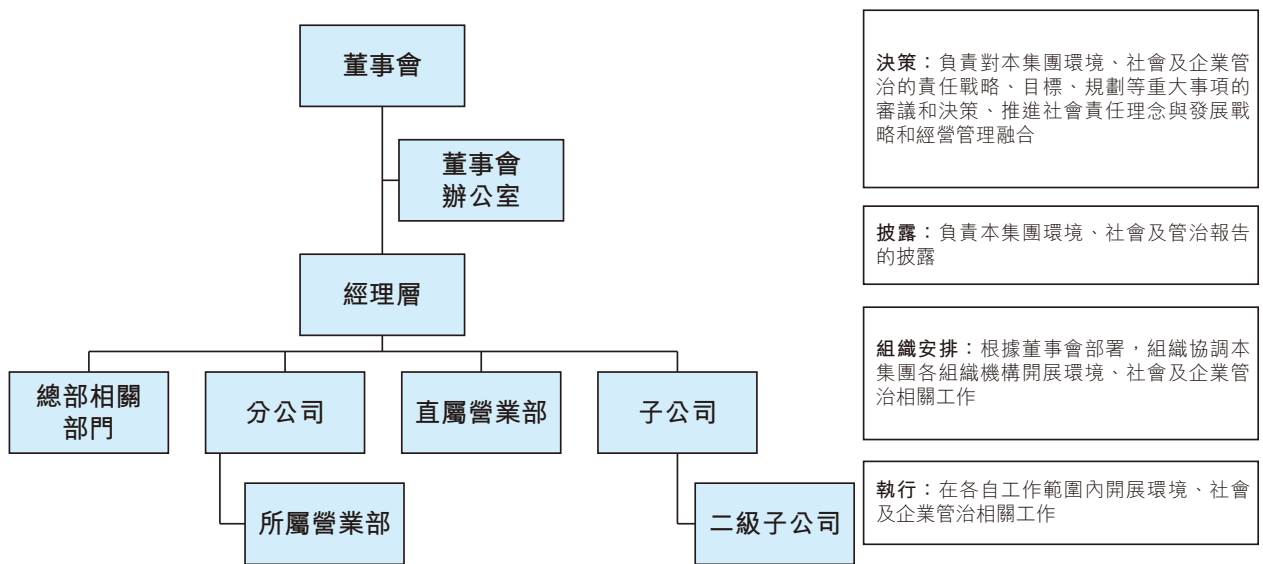
本報告的數據及資料源於本集團各項存檔文件、記錄及統計。本報告所披露的內容和數據經本公司董事會審議通過。

本報告以PDF電子文件形式登載於香港交易及結算所有限公司披露易網站(<http://www.hkexnews.hk>)及本公司網站(<http://www.luzhengqh.com>)。



一、環境、社會及企業管治管理體系

在遵循香港聯合交易所有限公司之環境、社會及企業管治信息合規披露要求基礎上，結合自身業務發展策略，本集團不斷深化環境、社會及企業管治管理理念，積極提升環境、社會及企業管治表現，在履行企業社會職責過程中，努力朝著期貨行業可持續發展的目標前行。2017年為強化本集團整體環境、社會及企業管治管理並有效落實各部門主體責任，本集團正積極建立包括董事會、經理層、董事會辦公室、總部相關部門、分公司、直屬營業部及子公司在內的管理體系。

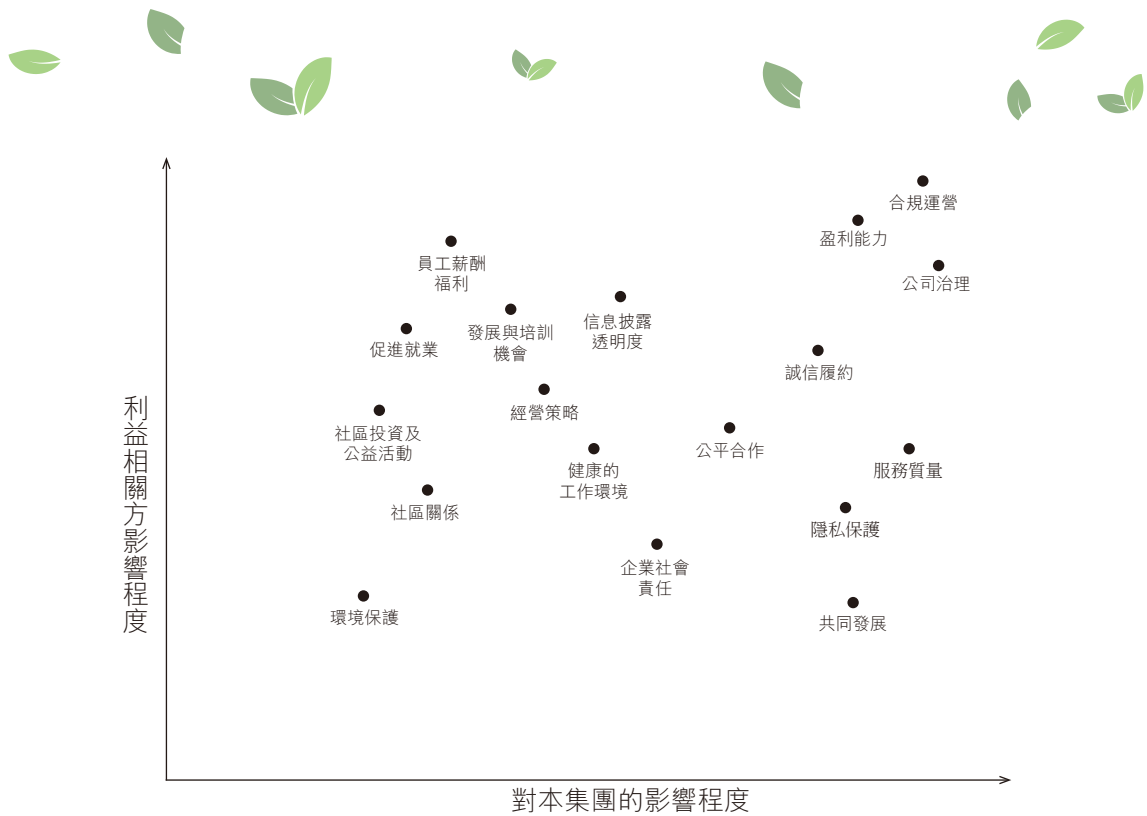


本集團環境、社會及企業管治組織架構



在形成環境、社會及企業管治管理體系與落實環境、社會及企業管治責任的過程中，本集團認識到與利益相關方保持良好溝通的必要性。為此本集團梳理了6個利益相關方的溝通渠道，以保證彼此之間期望和訴求的有效傳達。不僅如此，在開展實際業務過程中，本集團評估了各利益相關方對自身環境、社會及企業管治關注點。

利益相關方	溝通渠道	關注點
政府及監管部門	重大會議、政策諮詢、事件匯報、機構考察、公文往來、信息披露	合規運營 公司治理
股東及投資者	股東大會、企業年報、信息披露、投資者來訪及其他交流活動	盈利能力 經營策略 環境保護 信息披露透明度
員工	員工滿意度調查、工會活動、員工培訓	員工薪酬福利 發展與培訓機會 健康的工作環境
供應商	供應商考察、會議溝通、招投標	公平合作 誠信履約
客戶	客戶拜訪、參觀介紹、客戶投訴熱線	服務質量 隱私保護 共同發展
社區及公眾	公益活動、結對幫扶、企業招聘宣傳、實習機會	企業社會責任 社區關係 社區投資及公益活動 促進就業



二、環境

本集團屬於低能耗、輕污染的非製造類金融企業，在日常運營過程中對環境的主要影響為耗紙、耗電、耗水、汽車尾氣等。

A1 排放物

本集團嚴格遵守《中華人民共和國環境保護法》、《中華人民共和國大氣污染防治法》等國家環境保護相關法律、法規進行日常經營，積極倡導環保理念並付諸於行動，報告期內未發生任何環保問題及相關訴訟。

本集團排放物主要來自能源消耗所產生的溫室氣體、日常辦公產生的污水、垃圾等無害廢棄物。其中溫室氣體排放主要來自以下兩方面的二氧化碳排放，一是商務用車使用汽油燃燒導致的二氧化碳排放，二是外購電力使用導致的二氧化碳排放。



由於數據的可得性和準確性，本報告期排放物指標僅統計了本公司總部、魯証經貿有限公司、魯証信息技術有限公司、山東交易市場清算所有限公司。¹

指標	單位	2017年數據
溫室氣體排放總排放量 ²	噸	760.99
人均溫室氣體排放	噸/人	2.71
直接排放	噸	29.54
汽油產生溫室氣體總量	噸	29.54
人均汽油產生溫室氣體	噸/人	0.11
間接排放	噸	731.45
電力消耗產生溫室氣體總量	噸	731.45
人均電力消耗產生溫室氣體	噸/人	2.60
產生生活污水 ³	噸	2,619.13
人均產生生活污水排放	噸/人	9.32
產生有害廢棄物 ⁴	噸	1.16
人均產生有害廢棄物	噸/人	0.004
產生無害廢棄物 ⁵	噸	2.00
人均產生無害廢棄物	噸/人	0.01

¹ 該統計範圍，報告期末員工總數為281人。

² 根據本集團的業務特徵，主要排放物為溫室氣體中的二氧化碳，相關排放數據根據碳排放交易網 (<http://www.tanpaifang.com/tanjisuanqi/>)中，碳排放計算器計算得出。

³ 參考《國家標準城市排水工程規劃規範》，取0.85作為排污系數折算得出。

⁴ 主要是由於直接消耗汽油產生的硫氧化物。

⁵ 主要是由於辦公產生的廢棄紙張以及訂閱的報紙。本集團硒鼓通過充粉方式循環利用，故基本不產生廢棄物。

不同於傳統的生產型企業，本集團所從事的業務主要為金融服務，目前的相關排放物均為正常辦公所消耗和排放，不存在過度使用能源或其他資源而造成的過度排放。本集團致力於通過塑造友好的環境社會的企業文化，推動集團範圍內節能減排，但是由於正常辦公需要和業務發展，客觀地評估本集團範圍內節能減排的提升空間相對有限。



本集團的主要有害廢棄物排放為由於直接使用化石能源—汽油，造成的硫氧化物的排放，本集團採購商務用車和公司商務用車加油已經積極響應了中國國務院出台的《大氣污染防治行動計劃》，採購環保達標的汽車和國V汽油，以提升排放質量，降低對環境的負面影響；在無害廢棄物排放方面，本集團統一交由相關地區的廢品收購站，通過有償回收，減少環境污染，以提高物資循環利用。

A2 資源使用

本集團倡導綠色辦公，積極採取措施減少資源消耗，降低能源消耗。

本集團資源使用主要包括用水、用電、車輛所用汽油。本集團推行無紙化電子化辦公流程和制度，鼓勵採用雙面打印減少紙張使用，愛惜辦公用品；積極使用視頻會議系統減少出差率、合理安排公司商務用車等，最大限度節約資源，構建環境友好型企業；安排物業人員巡檢關閉或調低夜間照明系統。經本集團引導與宣傳，本集團員工2017年積極採用電子化辦公流程和制度處理工作事宜，減少了紙張的消耗；提高了公共交通出行和商務用車效率；積極採用電話會議或者視頻會議，減少了出差頻率。

指標	單位	2017年數據
直接能源消耗	升	14,544.45
汽油消耗量	升	14,544.45
人均汽油消耗量	升/人	51.76
間接能源消耗	千瓦時	805,783.17
辦公用電	千瓦時	805,783.17
人均辦公用電消耗量	千瓦時/人	2,867.56
辦公複印用紙總量	噸	0.90
人均辦公複印用紙消耗量	噸/人	0.003
耗水量	噸	3,081.33
人均耗水量	噸/人	10.97
硒鼓消耗量	個	247
人均硒鼓消耗量	個/人	0.88
新換	個	101
充粉	個	146



不同於傳統的生產型企業，本集團所從事的業務主要為金融服務，不從事具體的生產活動，因此製成品所用包裝材料等相關規定及關鍵績效指標不適用本集團。

A3 環境及天然資源

本集團積極倡導和推動綠色金融，積極參與期貨行業各項標準的制定和推動市場發展的各項工作。組織企業社會責任(CSR)之無痕環境課堂等健步走與環境清理相結合的活動，本集團號召員工參與保護環境，倡導垃圾分類，對辦公產生的廢品售賣讓可再生資源進入社會重新利用。

本集團推出並實施一系列規章制度，建立相應企業文化積極倡導環境保護理念和綠色發展理念。報告期內，本集團採取的具體措施包括但不限於：

本集團積極營造無紙化辦公環境，利用辦公自動化管理系統(OA系統)完成發佈公告通知，宣傳公司新聞，傳達政策法規，分享研究報告，規範業務流程，公司內部郵件往來等功能，極大的提高管理效率，降低運營成本，節省大量辦公文件印製。本集團鼓勵在工作過程中的複印打印應採取雙面使用紙張方式，單面使用後的紙張應當對未使用的頁面進行再次使用；明確要求不可避免使用紙張時，盡量使用再生紙張及充分利用。印製帶有本集團標誌的玻璃杯代替一次性紙杯。

本集團制定公司制度及相關通知，辦公場所採購及應用電器設備時，全面評估電能消耗，選擇國家認證的低能耗電器。在本集團辦公場所全面使用節能燈用於照明，並在光線充足時要求間隔開放以最大節約電能消耗；並安排專人每天對除保證本集團正常運營機器設備外的所有電器進行非工作時間關閉檢查。加強對信息技術機房設備的管理，在滿足使用的條件下應用低能耗高效率設備更替高能耗低效率設備。本集團全面推廣夏季空調26度，冬季空調24度的制度。對於打印機、複印機、傳真機、碎紙機等辦公必備設備，本集團建立並實施聯網共享及閒時關機制度。本集團嚴禁大功率非辦公電器的使用。



本集團在總部各部門及分支機構所屬的洗手間、茶水間明顯位置張貼宣傳語，倡導全體員工保護環境、節約用水。要求各部門及分支機構安排專人定期檢查，杜絕設備故障引起的水資源浪費行為。經本公司綜合部不定期巡查，2017年未發現水資源過度使用和浪費情況。

本集團制定明確的車輛使用制度，通過里程油耗登記等嚴格控制車輛使用行為。採用本集團車輛及駕駛員的集中管理、統一調配，提高車輛使用效率，降低能耗及污染物排放。制度明確要求非辦公及節假日期間，本集團車輛全部封存，分支機構也需提供本集團車輛封存證明資料。本集團積極倡導員工出差公幹使用環保或公共交通工具，鼓勵員工在保證安全的情況下同城外出採用共享交通工具方式出行。

報告期內本集團並未發生環境服務事故，亦未因環境勿擾收到任何投訴、處罰及制裁。

三、社會

B1 僱傭

本集團遵守《中華人民共和國勞動法》、《中華人民共和國勞動合同法》以及勞動合同的有關條款以及適用的勞動法規處理終止聘用事宜，建立了規範的員工招聘和離職流程。本集團堅持「機會均等、公平競爭、全面考核、擇優錄用」的原則開展招聘工作。同時建立全面內部評估和績效考核機制，保障員工公平的晉升機會。員工入職與本集團簽訂勞動合同，本集團員工的工作時間符合有關要求。本集團禁止選用童工並禁止強制勞工。員工因個人原因決定離職時可以提出離職申請，完成離職手續後，即可從本集團離職。本集團主動與員工解除或中止勞動關係時，本集團會根據相關法律法規的要求，履行提前告知義務。



1、員工劃分情況

	指標	單位	2017年
員工總數		人	525
按性別劃分	男性	人	336
	女性	人	189
按僱傭類型劃分	合同制員工	人	525
	其他	人	0
按年齡組別劃分	30歲以下	人	212
	31歲—35歲	人	165
	36歲—40歲	人	75
	41歲—45歲	人	32
	45歲以上	人	41
按地區劃分	山東省內員工	人	387
	山東省外員工	人	138

2、薪酬福利

本集團員工薪酬由基本工資、獎金、績效、特殊獎勵和保險福利構成。基本工資根據工作職責、承擔責任、經營規模、同業水平、所處地區及知識經驗等綜合因素確定。績效工資是為了激勵營銷人員創造收入而提取的業績提成。

本集團和員工按照中國有關規定繳納各項社會統籌保險和住房公積金，有關社會統籌保險和住房公積金按照屬地化原則進行管理。



3、積極培養、吸納金融人才

本集團探索多種招聘合作方式加大人才引進力度，報告期內，本公司招錄各高校應屆畢業生11名，社會招聘74人。本公司積極溝通人才服務局、金融工作辦公室等部門，加深高校合作，報告期內先後參加濟南市人才服務局組織的校園招聘，山東省金融工作辦公室組織的赴復旦大學校園招聘及濟南市人社局組織的海外人才招聘會。按照產學研相結合的社會需求，本公司積極吸納高校學生進入本公司鍛煉實習，提升學生實踐能力，增強學生就業競爭力，報告期內，本公司吸納26人次各高校學生進入本公司鍛煉實習。

2017年，本集團積極參與了中國金融期貨交易所、中國期貨業協會（「中期協」）主辦的第五屆「中金所杯」全國大學生金融知識大賽。通過積極對接山東大學和山東財經大學兩所高校，本公司聯合上述高校，通過學校網站、內部信息發佈系統、校園宣講等方式，宣傳鼓勵學生報名參賽。發動山東大學的中泰證券金融研究院、經濟研究院、數學院、經濟學院、管理學院，山東財經大學的金融學院、數學與數量經濟學院、經濟學院，兩所高校共300多名在讀學生參加了宣講培訓會，對培訓期貨市場人才起到了積極的作用。



B2 健康與安全

本集團堅持以人為本，關愛員工健康安全，完善員工健康保障的機制，認真落實安全演練教育培訓。

1、關愛員工

本集團每年組織員工在三級甲等醫院體檢，為全體員工提供補充醫療保障，確保員工身體健康。本集團嚴格執行有關法律法規的規定，為員工辦理各項社會保險，包括基本養老保險、基本醫療保險、失業保險、工傷保險和生育保險等。同時，本集團在中國山東省濟南市和各分支機構所在城市住房公積金管理部門，為員工辦理住房公積金。本集團充分保障員工合法權益，按照《中華人民共和國勞動法》及相關法律規定，嚴格執行法定假日及休假制度，包括：帶薪年休假、事假、病假、工傷假、婚假、喪假、產假和陪产假。

2、保障員工健康安全

本集團認真貫徹上級安全生產法規指令，全面落實企業安全生產主體責任，強化企業內部管理，做好安全維穩工作，為員工提供一個安全健康的工作環境。堅持「預防為主，積極防範」的原則，健全制度，完善措施，落實責任。認真落實「預防為主，防消結合」的消防工作方針，加強全員消防知識培訓和內部消防設施器材管理。制定應急事件處理辦法，舉辦安全生產應急救援演練，不斷修訂完善應急預案。按照「一崗雙責」「屬地管理」原則，全面排查信訪穩定風險，制定「零報告」報備制度，及時處置各類突發事件，防範各種影響社會穩定事件的發生。通過組織全員安全培訓及考核等方式，提升員工安防及消防安全意識。報告期內，本集團未發生任何信息技術系統、安全保衛及健康安全責任事故。



2017年6月，為進一步加強安全生產宣傳教育工作，牢固樹立安全發展理念，全面提升員工安全意識，本集團組織開展了「安全生產月」活動，並進行了全員性的安全生產兩個體系建設的培訓及知識測試，員工的安全觀念得到持續提高。

職業健康與安全績效指標

	單位	2017年
因工作關係而死亡的人數	人	0
因工傷損失工作日數	人	0

3、組織豐富的文體活動

本公司總部各部門、分公司及直屬營業部分別組織各類活動，讓員工豐富業餘生活，增進了解，提高凝聚力。

本公司開展節日慶典活動，組織舉辦新年聯歡晚會、「三八」國際婦女節等節日慶祝活動。

本公司舉辦健步走活動、「守正創新 精業篤行」主題演講比賽、「我與公司共成長」主題徵文活動，為職工提供一個展示自我的舞台，近300名員工參加。

本公司在總部所在地等員工人數集中的地區開展職工興趣活動，積極組織籌備了籃球組、乒乓球組、羽毛球組、文藝組四個工會小組，各小組組織有相關愛好的職工進行訓練，不定期開展比賽活動。

2017年5月20、21日，本公司組織員工參加了由本公司控股股東中泰證券股份有限公司（「中泰證券」）工會主辦、濟南奧丁體育俱樂部協辦的第二屆「中泰證券杯」乒乓球邀請賽暨投資者聯盟賽，本公司參賽員工熱情高漲，不畏強手，奮發向上。經初賽、複賽最終獲得中泰證券組混合團體第三名、男子單打第一名、女子單打第八名的可喜成績。



B3 發展與培訓

本集團重視員工多元化發展，積極推動日常溝通，通過制定嚴格的培訓計劃而推進員工的發展，盡展所長。本集團關注對高層職級員工的領導力與管理職能培訓，拓展其國際化視野，提高其變革管理能力、戰略分析能力、經營管理能力、業務協同能力、防範風險能力和綜合人文素養等，培養高素質的企業經營管理者；本集團關注對中層職級員工的執行力和專業技能培訓，著力提升其專業理論水平、業務執行能力、組織開放能力、業務創新能力等；本集團關注對基層員工的職業化和通用技能培訓，加強其企業業務運行、工作流程、規章制度等方面培訓，提升其專業溝通能力、客戶服務能力、團隊協作能力、辦公操作能力等。

報告期內，本公司共舉辦各類內部培訓70餘次，內容包括期貨品種、原油期貨、資管、期權、風險管理、投資者適當性等方面，培訓圍繞著員工工作需要、業務開展需求展開。本公司選派員工參加期貨交易所、中期協和山東省期貨業協會、期貨行業組織等舉辦的外出培訓60餘次，主要從以下方面開展培訓工作：一是組織全員考試夯實基礎知識，全年組織兩次全員考試(期權、合規)；二是線上線下課程有機結合，著力開展新品種、重點品種培訓，建立了期權、原油網上系列課程並舉辦3次現場培訓；三是精心設計課程，培養複合型大客戶經理；四是管理類培訓增多，提升管理效能；五是E-Learning平台持續向本公司後台員工和營銷人員提供網絡培訓，截至2017年12月31日，人課數51,903，總學習時間超過20,000小時，(較2016年年底人課數27,427，總學習時間超過4,663小時)有了大幅提升，自行製作微課程141門(2016年年底36門)。從使用效果來看，E-Learning網絡培訓平台在促進員工各類業務學習、優質培訓資源再利用等方面正日益發揮積極作用。



員工培訓指標

	指標	單位	2017年
按性別劃分的受訓僱員百分比	男性	%	100
	女性	%	100
按僱員類別劃分的受訓僱員百分比	高級管理層	%	100
	中級管理層	%	100
	基層員工	%	100
按性別劃分的僱員受訓平均時數	男性	小時/人	44
	女性	小時/人	49
按僱員類別劃分的僱員受訓平均時數	高級管理層	小時/人	28
	中級管理層	小時/人	36
	基層員工	小時/人	48

B4 勞工準則

本集團嚴格按照勞工監管要求，不僱用童工，不強制勞工，給予員工合理的假期。報告期內，本集團未知悉有僱用童工，強制勞工等違反勞工準則的案件發生。

本公司工會依法推進和完善以職工代表大會為基本形式的民主管理，2017年共召開三次職工代表大會，審議通過了《魯証期貨股份有限公司工會委員會2016年工作總結及2017年工作計劃》、《魯証期貨股份有限公司工會委員會2016年工會財務決算及預算完成情況報告》、《魯証期貨股份有限公司工會委員會2016年度經費審查報告》、《關於選舉魯証期貨股份有限公司職工代表監事的議案》、《關於增補職工代表的議案》、《魯証期貨股份有限公司員工內退管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司2017年度績效考核管理辦法》、《關於申請山東省富民興魯勞動獎狀的議案》等議案，保障了職工的知情權、參與權、表達權、監督權。



B5 供應鏈管理

由於業務性質，本集團在業務層面無主要供應商。就辦公用品方面，本集團公平公正開展採購工作，在甄選合作夥伴時，會充分考慮供應商的商業信譽，以及在過往經營有無違法、違規紀律和重大法律糾紛，同時對供應商具備的能力、經驗、資質、信譽、財務狀況、質量保證體系等具體標準進行有效的資格審查。

報告期內，本集團並未知悉供應商在商業道德、環境保護等方面有任何重大實際或潛在的負面影響。

B6 產品責任

本集團積極履行企業公民社會責任，維護投資者合法權益，做好投資者教育與服務工作，不斷完善客戶服務體系建設，提升客戶服務能力，重視客戶信息安全。本集團尊重和保護知識產權，在合同規定範圍內使用經授權的軟件與硬件產品。本集團嚴格遵守《中華人民共和國廣告法》、《中華人民共和國商標法》，本集團產品推介與宣傳均符合相關規定，並利用相關法例維護自身合法權益。



1、服務及產品安全

資金安全

本公司根據中國國務院《期貨交易管理條例》，中國證監會《期貨公司監督管理辦法》、《期貨經紀公司客戶保證金封閉管理暫行辦法》等監管條例規定，制定了《客戶保證金安全存管管理辦法》並遵照執行。客戶的期貨交易保證金均全額存放於本公司期貨交易結算銀行賬戶當中，與本公司自有資金分戶存放，實行封閉管理，封閉圈內的資金受中國期貨市場監控中心的第三方監控，客戶的資金安全能夠得到有效保護；資產管理業務資金安全方面，本公司根據《中華人民共和國證券投資基金法》、中國證監會《期貨公司資產管理業務試點辦法》等監管條例規定，本公司制定了《資產管理業務管理制度》等內控制度並遵照執行，聘請具有基金托管業務資格或私募基金綜合托管業務資格的機構對本公司發行的資管產品進行托管，以保障客戶委託資產的安全。

信息系統安全

本公司根據中國國務院《期貨交易管理條例》，中國證監會《期貨公司監督管理辦法》、《證券期貨業信息安全保障管理辦法》等監管條例規定，制定了《信息系統管理制度》、《信息系統安全管理制度》及《網上交易安全管理辦法》等內控制度，以確保本公司核心業務系統及客戶交易系統的安全平穩運行。

2、維護投資者權益

本公司積極引導投資者樹立理性投資理念，提高風險防範意識，切實保護投資者合法權益，積極組織開展投資者教育活動，同時不斷規範、完善投資者適當性管理及投教工作，並通過組織相關培訓及考試，提高分支機構從業人員對投資者適當性管理、客戶交易行為管理的有效落實能力。並通過組織大學生金融挑戰賽等方式，深入高校面向青年群體做好投資者教育和保護工作。



2017年，本公司舉辦投資者教育活動98場，現場引導6,000餘名投資者樹立正確投資理念；本公司各分支機構在營業場所醒目位置張貼、懸掛或滾動顯示了防範非法集資、理性投資和反洗錢工作相關的警示標語，引導投資者提高風險防範意識，切實保護自身合法權益；組織本公司各分支機構從業人員開展了3次視頻會議，指導從業人員有效的開展投資者教育和投資者適當性管理的相關工作；本公司共6次深入山東大學、山東財經大學兩所高校，向青年群體開展了投資者教育和保護工作。

本公司根據中國國務院《期貨交易管理條例》，中國證監會《期貨公司監督管理辦法》、《證券期貨業信息安全保障管理辦法》等監管條例規定，制定了《經紀業務客戶檔案管理辦法》、《資產管理業務檔案管理辦法》、《資產管理業務保密辦法》、《信息系統數據安全管理辦法》等內控制度並遵照執行。客戶檔案屬於本公司機密資料，本公司設置了檔案保管部門及資料調閱流程，按最小化、業務與技術分離等原則分配系統權限，以有效保護客戶隱私。

3、提升客戶滿意度

本公司堅持以滿足客戶需求為中心，不斷優化客戶服務體系的配套系統，完善客戶服務體系建設，提高客戶服務能力，以客戶需求和資產配置為導向，優化業務办理流程，加大業務創新力度，為客戶提供多樣化業務服務。

2017年，本公司積極在客戶諮詢、客戶回訪、客戶投訴等主要日常工作的開展中，及時解決客戶問題，通過與客戶的交流，及時發現服務流程、制度上的問題，反映給相關部門解決。2017年，本公司共處理客戶電話業務12,796次，回訪客戶1,675戶，客戶滿意率達到了90%，對客戶不滿意電話情況進行後續檢查，對由於客戶服務處理問題不當等原因造成的事項予以及時進行糾正，防止問題再次出現。同時根據客戶問題，分析客戶的行為習慣，整理總結客戶常見問題，將服務做到客戶需求之前。



B7 反貪污

本公司按照《中華人民共和國刑法》、《反不正當競爭法》、《關於禁止商業賄賂行為的暫行規定》中關於賄賂、勒索、欺詐及洗黑錢相關規定設有專門的反貪污政策，建立了反洗錢內控體系，制定了包括《魯証期貨股份有限公司反洗錢內控制度》、《魯証期貨股份有限公司客戶身份識別管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司大額交易和可疑交易報告管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司客戶洗錢和恐怖融資風險評估及分類管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司反洗錢及反恐怖融資快速協查及資產凍結工作管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司洗錢風險自評估工作管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司反洗錢保密工作管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司反洗錢工作考評管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司反洗錢培訓工作管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司反洗錢宣傳工作管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司反洗錢非現場監管工作管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司反洗錢工作業務實施細則》及《魯証期貨股份有限公司營業部反洗錢工作指引》在內的13項反洗錢制度性文件。本集團在反腐倡廉工作中注重超前預防，完善制度制約，加強監督，不斷強化對管理人員的約束，實現從源頭上阻斷不正之風和腐敗滋生的通道，為企業提供良好的發展環境。

本集團積極開展多種形式的廉潔文化教育、培訓和宣傳等活動，強化各級員工廉潔自律意識。切實把防範化解思想道德風險、崗位職責風險、業務流程風險、制度機制風險融入日常經營管理之中，督促各級領導幹部認真履行「一崗雙責」，不斷提高廉潔風險防控的滲透力。加強對費用支出、選人用人等重點領域、關鍵環節和重要崗位的監督檢查。通過公佈舉報郵箱、電話等方式擴寬問題線索反映渠道，進一步完善責任追究制度體系。

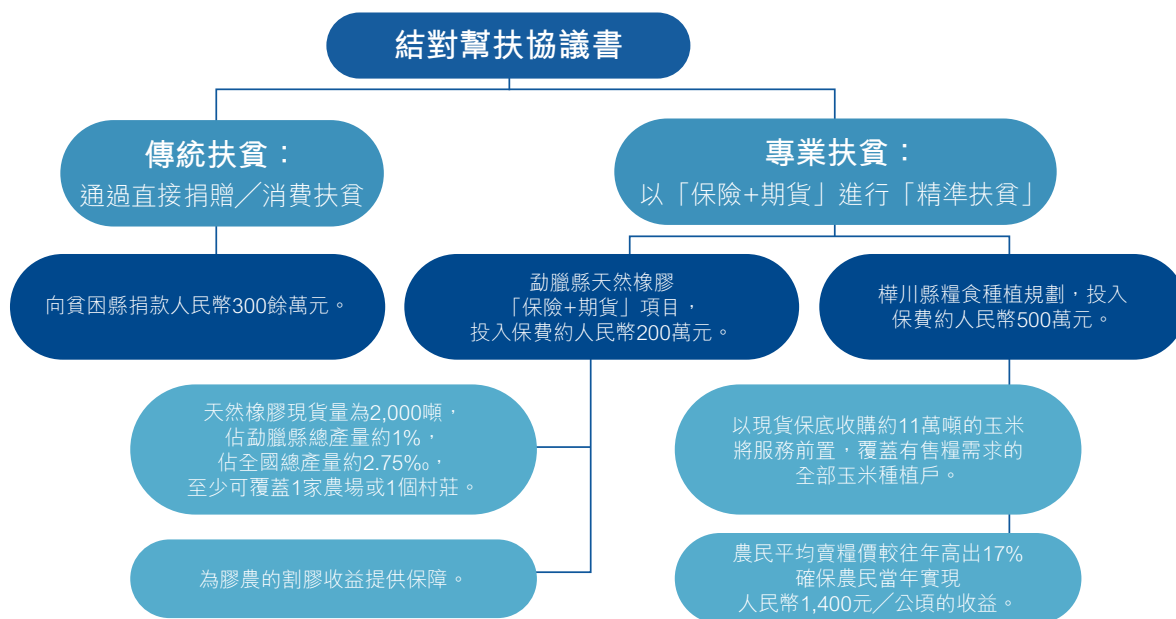


報告期內，本集團反腐倡廉工作情況良好，無負面事件發生。

B8 社區投資

2017年，本集團繼續貫徹落實黨中央、中國國務院和中國證監會有關扶貧工作的統一部署、響應中期協發起的期貨行業服務國家脫貧攻堅戰略行動倡議。在2016年，本集團與黑龍江省樺川縣簽訂結對幫扶協議之後，2017年本集團又與陝西省延長縣、雲南省猛臘縣兩個國家級貧困縣簽訂了結對幫扶協議。

在產業扶貧方面，2017年本集團根據樺川縣糧食種植規劃，在大連商品交易所的支持下投入保費約人民幣500萬元，通過「訂單+保險+期貨」的方式對當地16萬餘畝玉米以現貨保底收購的方式將服務前置，覆蓋當年有售糧需求的主要玉米種植戶；投入保費人民幣200餘萬元在猛臘縣開展天然橡膠「保險+期貨」項目，涉及天然橡膠現貨量2,000噸，佔猛臘縣天然橡膠總產量約1%。2017年，本集團在專業扶貧方面的作法被中期協作為典型，並接受了中央人民廣播電台宣傳採訪。



四、環境社會與企業管制指標對照表

主要範疇、層面、一般披露及關鍵績效指標		披露情況
範疇A：環境		
層面A1：排放物		
一般披露		二、環境 A1排放物
A1.1	排放物種類及相關排放數據	二、環境 A1排放物
A1.2	溫室氣體總排放量(以噸計算)及(如適用)密度(如以每產量單位、每項設施計算)	二、環境 A1排放物
A1.3	所產生有害廢棄物總量(以噸計算)及(如適用)密度(如以每產量單位、每項設施計算)	二、環境 A1排放物
A1.4	所產生無害廢棄物總量(以噸計算)及(如適用)密度(如以每產量單位、每項設施計算)	二、環境 A1排放物
A1.5	描述減低排放量的措施及所得成果	二、環境 A1排放物
A1.6	描述處理有害及無害廢棄物的方法、減低產生量的措施及所得成果	二、環境 A1排放物



主要範疇、層面、一般披露及關鍵績效指標		披露情況
層面A2：資源使用		
一般披露		二、環境 A2資源使用 A3環境及天然資源
A2.1	按類型劃分的直接及／或間接能源(如電、氣或油)總耗量(以千個千瓦時計算)及密度(如以每產量單位、每項設施計算)	二、環境 A2資源使用
A2.2	總耗水量及密度(如以每產量單位、每項設施計算)	二、環境 A2資源使用
A2.3	描述能源使用效益計劃及所得成果	二、環境 A2資源使用
A2.4	描述求取適用水源上可有任何問題，以及提升用水效益計劃及所得成果	二、環境 A2資源使用 A3環境及天然資源
A2.5	製成品所用包裝材料的總量(以噸計算)及(如適用)每生產單位估量	二、環境 A2資源使用



主要範疇、層面、一般披露及關鍵績效指標		披露情況
層面A3：環境及天然資源		
一般披露		二、環境 A3環境及天然資源
A3.1	描述業務活動對環境及天然資源的重大影響及已採取管理有關影響的行動	二、環境 A3環境及天然資源
範疇B：社會		
層面B1：僱傭		
一般披露		三、社會 B1僱傭
B1.1	按性別、僱傭類型、年齡組別及地區劃分的僱員總數	三、社會 B1僱傭
B1.2	按性別、年齡組別及地區劃分的僱員流失比率	未披露
層面B2：健康與安全		
一般披露		三、社會 B2健康與安全
B2.1	因工作關係而死亡的人數及比率	三、社會 B2健康與安全
B2.2	因工傷損失工作日數	三、社會 B2健康與安全
B2.3	描述所採納的職業健康與安全措施，以及相關執行及監察方法	三、社會 B2健康與安全
層面B3：發展及培訓		
一般披露		三、社會 B3發展與培訓
B3.1	按性別及僱員類別(如高級管理層、中級管理層等)劃分的受訓僱員百分比	三、社會 B3發展與培訓
B3.2	按性別及僱員類別劃分，每名僱員完成受訓的平均時數	三、社會 B3發展與培訓



主要範疇、層面、一般披露及關鍵績效指標		披露情況
層面B4：勞工準則		
一般披露		三、社會 B4勞工準則
B4.1	描述檢討招聘慣例的措施以避免童工及強制勞工	未披露
B4.2	描述在發現違規情況時消除有關情況所採取的步驟	未披露
層面B5：供應鏈管理		
一般披露		三、社會 B5供應鏈管理
B5.1	按地區劃分的供應商數目	未披露
B5.2	描述有關聘用供應商的慣例，向其執行有關慣例的供應商數目、以及有關慣例的執行及監察方法	未披露
層面B6：產品責任		
一般披露		三、社會 B6產品責任
B6.1	已售或已運送產品總數中因安全與健康理由而須回收的百分比	不適用
B6.2	接獲關於產品及服務的投訴數目以及應對方法	三、社會 B6產品責任
B6.3	描述與維護及保障知識產權有關的慣例	未披露
B6.4	描述質量檢定過程及產品回收程序	不適用
B6.5	描述消費者資料保障及私隱政策，以及相關執行及監察方法	三、社會 B6產品責任



主要範疇、層面、一般披露及關鍵績效指標		披露情況
層面B7：反貪污		
一般披露		三、社會 B7反貪污
B7.1	於匯報期內對發行人或其僱員提出並已審結的貪污訴訟案件的數目及訴訟結果	三、社會 B7反貪污
B7.2	描述防範措施及舉報程序，以及相關執行及監察方法	三、社會 B7反貪污
層面B8：社區投資		
一般披露		三、社會 B8社區投資
B8.1	專注貢獻範疇(如教育、環境事宜、勞工需求、健康、文化、體育)	三、社會 B8社區投資
B8.2	在專注範疇所動用資源(如金錢或時間)	三、社會 B8社區投資



鲁证期货
LUZHENG FUTURES

LUZHENG FUTURES COMPANY LIMITED
魯証期貨股份有限公司