



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

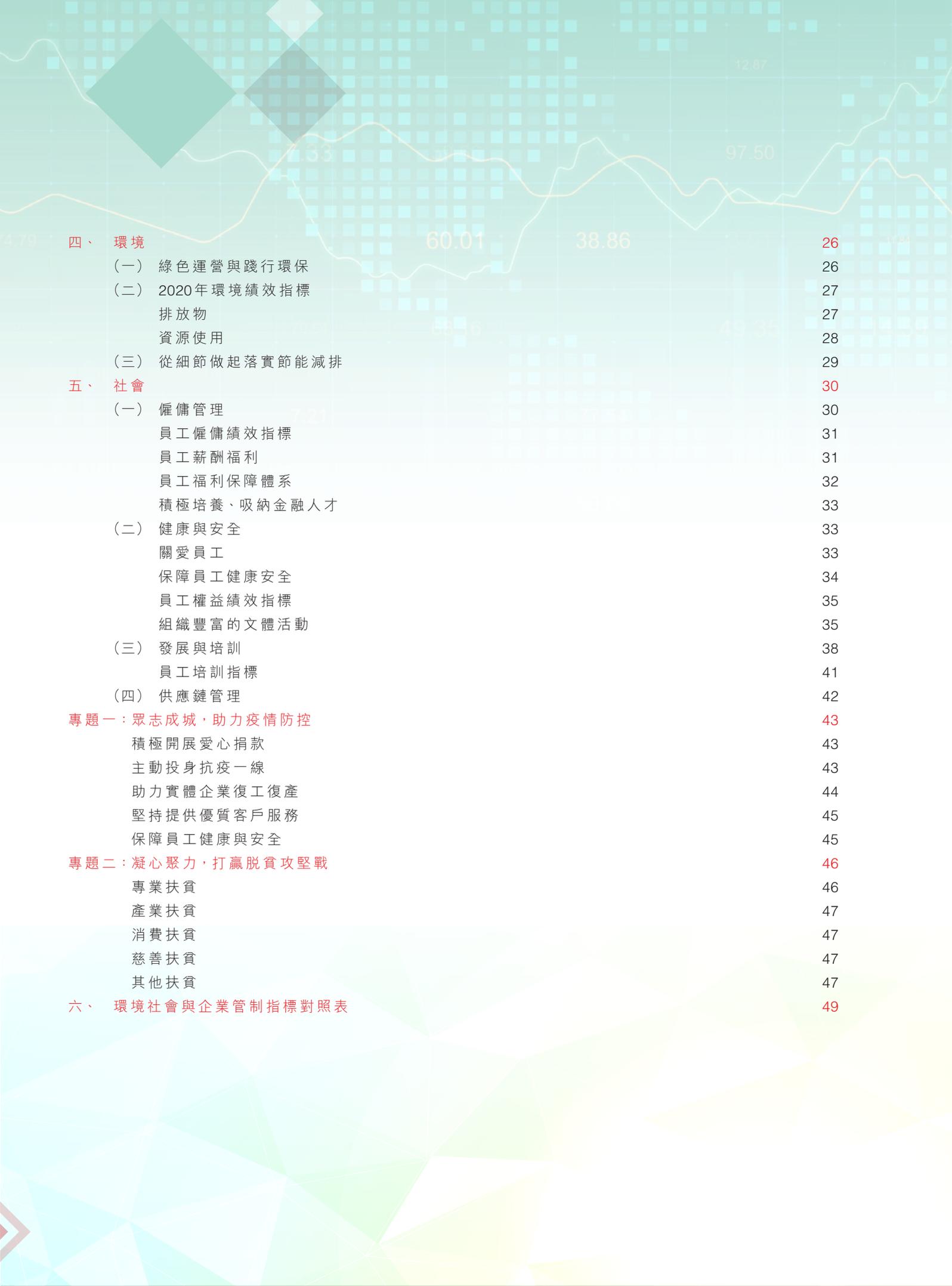
(於中華人民共和國註冊成立之股份有限公司)

(股份代號：01461)



2020

環境、社會及管治報告



四、	環境	26
(一)	綠色運營與踐行環保	26
(二)	2020年環境績效指標	27
	排放物	27
	資源使用	28
(三)	從細節做起落實節能減排	29
五、	社會	30
(一)	僱傭管理	30
	員工僱傭績效指標	31
	員工薪酬福利	31
	員工福利保障體系	32
	積極培養、吸納金融人才	33
(二)	健康與安全	33
	關愛員工	33
	保障員工健康安全	34
	員工權益績效指標	35
	組織豐富的文體活動	35
(三)	發展與培訓	38
	員工培訓指標	41
(四)	供應鏈管理	42
專題一：	眾志成城·助力疫情防控	43
	積極開展愛心捐款	43
	主動投身抗疫一線	43
	助力實體企業復工復產	44
	堅持提供優質客戶服務	45
	保障員工健康與安全	45
專題二：	凝心聚力·打贏脫貧攻堅戰	46
	專業扶貧	46
	產業扶貧	47
	消費扶貧	47
	慈善扶貧	47
	其他扶貧	47
六、	環境社會與企業管制指標對照表	49

釋義

《公司章程》	指	《魯証期貨股份有限公司章程》
審計委員會	指	本公司董事會審計委員會
董事會	指	本公司董事會
《企業管治守則》	指	《上市規則》附錄十四所載的《企業管治守則》
中國、我國、全國、境內	指	中華人民共和國，就本報告而言，不包括香港、中華人民共和國澳門特別行政區及台灣
本公司、魯証期貨	指	魯証期貨股份有限公司，於2012年12月10日在中國重組成為股份有限公司(包括其前身—山東泉鑫期貨經紀有限公司，曾更名為魯証期貨經紀有限公司及隨後更名為魯証期貨有限公司)，其H股在香港聯交所主板上市(股份代號：01461)
中國證監會	指	中國證券監督管理委員會
董事	指	本公司董事
股東大會	指	本公司股東大會
本集團	指	本公司及其附屬公司
香港	指	中華人民共和國香港特別行政區
香港聯交所	指	香港聯合交易所有限公司
《上市規則》	指	香港聯合交易所有限公司證券上市規則

魯証資本	指	魯証資本管理有限公司(前稱魯証經貿有限公司)，於2013年4月24日在中國成立的有限公司，為本公司全資附屬公司
魯証信息技術	指	魯証信息技術有限公司，於2015年2月15日在中國成立的有限公司，為本公司全資附屬公司
提名委員會	指	本公司董事會提名委員會
場外期權	指	在非集中性的交易場所進行的非標準化的期權合約交易
人行	指	中國人民銀行
薪酬與考核委員會	指	本公司董事會薪酬與考核委員會
風險控制委員會	指	本公司董事會風險控制委員會
人民幣	指	中國法定貨幣
股東	指	本公司股份持有人
戰略發展委員會	指	本公司董事會戰略發展委員會
監事	指	本公司監事
監事會	指	本公司監事會
中泰證券	指	中泰證券股份有限公司，前稱齊魯證券有限公司，於2001年5月15日在中國成立的有限公司，並於2020年6月3日在上海證券交易所上市(證券代碼：600918)，由萊蕪鋼鐵集團有限公司擁有其41.32%權益，為本公司控股股東之一

一、關於本報告

(一) 報告簡介

本環境、社會及管治報告(「本報告」)披露了本集團於中國的業務運營中，在環境、社會及企業管治方面的相關舉措及表現。本報告所披露的內容和數據已經董事會審議通過。

(二) 時間範圍

本報告的時間範圍是由2020年1月1日至2020年12月31日(「報告期」)。

(三) 發佈週期

本報告每年發佈一次。上期報告已於2020年7月份發佈。

(四) 編製依據

本報告是本公司依據香港聯交所《上市規則》附錄二十七之《環境、社會及管治報告指引》編製，旨在披露本公司在為股東、客戶創造價值的同時，積極踐行社會責任的綜合表現。本公司已遵守《環境、社會及管治報告指引》列載的所有「不遵守就解釋」條文。

(五) 數據來源

本報告使用數據及信息來自本公司內部各項存檔文件、記錄及統計，不存在任何虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏。

(六) 發佈形式

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>)。

二、關於本公司

(一) 本公司簡介

本公司是經中國證監會批准，在山東省市場監督管理局註冊登記，由中泰證券控股的大型期貨公司。本公司總部設於山東濟南，目前，註冊資本人民幣10.019億元，員工400餘人，設有4家分公司，23家營業部，全資控股風險管理子公司—魯証資本、全資控股信息技術子公司—魯証信息技術，同時依托中泰證券遍佈全國各地的42家證券分公司、280多家證券營業部，形成了覆蓋全國的服務網絡。本公司業務範圍包括商品期貨經紀、金融期貨經紀、期貨投資諮詢和資產管理，擁有上海期貨交易所、大連商品交易所、鄭州商品交易所、上海國際能源交易中心股份有限公司、中國金融期貨交易所席位，是中國金融期貨交易所全面結算會員，是中國期貨業協會第二屆、第三屆、第四屆、第五屆理事會理事單位和山東省期貨業協會會長單位。本公司一貫秉承「合規风控至上，客戶利益至上，人才價值至上，創新發展至上」的經營理念，逐步強化金融中介機構應有的功能定位，將服務實體產業和金融機構作為業務發展的戰略重點，不斷提高服務實體經濟的能力和水平。



2015年7月7日，本公司在香港聯交所主板掛牌上市，成為我國期貨行業首家上市公司，以及香港聯交所首家以期貨為主業的上市公司，山東省首家金融類上市公司。

本公司擁有一支勇於創新、高效務實的經營管理團隊和一支經驗豐富、功力深厚的專業服務團隊。本公司將依托這兩支團隊，以真誠和高質量的服務回報客戶，通過扎實的工作推動行業進步和地方經濟的發展，努力將自身建設成具有感召力和文化魅力的現代金融企業。

經紀業務



秉持「以客戶為中心」的核心服務理念，整合本公司資源，發揮綜合優勢，全方位滿足不同類型客戶的多元化投資服務需求，以誠信服務贏得客戶信賴。

期貨投資諮詢業務



長期致力於綜合運用各種期貨衍生品工具助力客戶財富增值和企業穩健經營，能夠為廣大自然人投資者和產業客戶提供涵蓋基礎研究、投研策略和風險管理方案的投資諮詢服務。魯証期貨在蘋果、粳米、雞蛋、紅棗等品種樹立了研究品牌。

資產管理業務



魯証期貨是首批開展資產管理業務試點的期貨公司。經過多年實踐，魯証期貨已逐步形成了科學的投資管理模式、完備的風險控制體系以及高效的客戶服務方式。

風險管理公司業務



魯証期貨通過全資控股風險管理公司—魯証資本開展風險管理業務，主要為場外衍生品業務、做市業務、基差貿易、倉單服務、合作套保及其他與風險管理相關的業務。魯証資本通過期貨、期權等衍生品工具為不同產業鏈的大宗商品生產、貿易、加工等企業提供價格風險管理、庫存管理以及供應鏈金融等服務；同時，在業務開展過程中遵循誠實守信、審慎經營的原則，積極探索、不斷創新風險管理模式，提高風險管理水平，切實保障實體企業的穩健經營。魯証資本在場外衍生品業務方面位居行業前列。此外，魯証期貨在期權業務、信息系統建設等多方面均處於行業領先地位。

魯証期貨旨在運用期貨及衍生品工具，提供有競爭力的專業化服務和風險管理解決方案，持續為客戶創造價值，實現資本市場的中國夢。



(二) 社會認可與榮譽

- 榮獲第十三屆中國最佳期貨經營機構評選出的「最佳商品期貨產業服務獎」、「最佳金融期貨服務獎」、「最佳精準扶貧及愛心公益獎」、「最佳企業品牌建設獎」、「最受歡迎的期貨經營機構自媒體」、「最佳風險管理子公司服務創新獎」、「最佳期貨IT系統建設獎」、「最佳衍生品綜合服務創新獎」、「中國金牌期貨研究所」、「最佳中國期貨經營分支機構」稱號。
- 榮獲山東省精神文明建設委員會「省級文明單位」稱號。
- 榮獲大眾日報「3.15誠信金融品牌」及「山東金融業脫貧攻堅最具影響力品牌」稱號。
- 榮獲中國金融期貨交易所技術管理獎。
- 榮獲鄭州商品交易所「產業服務優秀會員獎」、「技術支持優秀會員獎」、「蘋果品種服務優秀會員獎」及「紅棗品種服務優秀會員獎」。
- 榮獲大連商品交易所「優秀會員獎」、「優秀農產品產業服務獎」、「優秀黑色產品產業服務獎」、「優秀技術支持獎」及「優秀場外市場支持獎」。
- 榮獲上海期貨交易所「能化產業服務獎」及「期權市場服務獎」。
- 榮獲「第十四屆全國期貨(期權)實盤交易大賽優秀投資者教育獎」。
- 榮獲中國蘋果產業協會「2020年度中國蘋果產業引領榜樣」稱號。
- 榮獲大眾報業集團(大眾日報社)、山東省工商業聯合會、山東省人民政府國有資產監督管理委員會和山東省市場監督管理局聯合頒發的「2020山東社會責任企業」。

(三)重要利益相關方

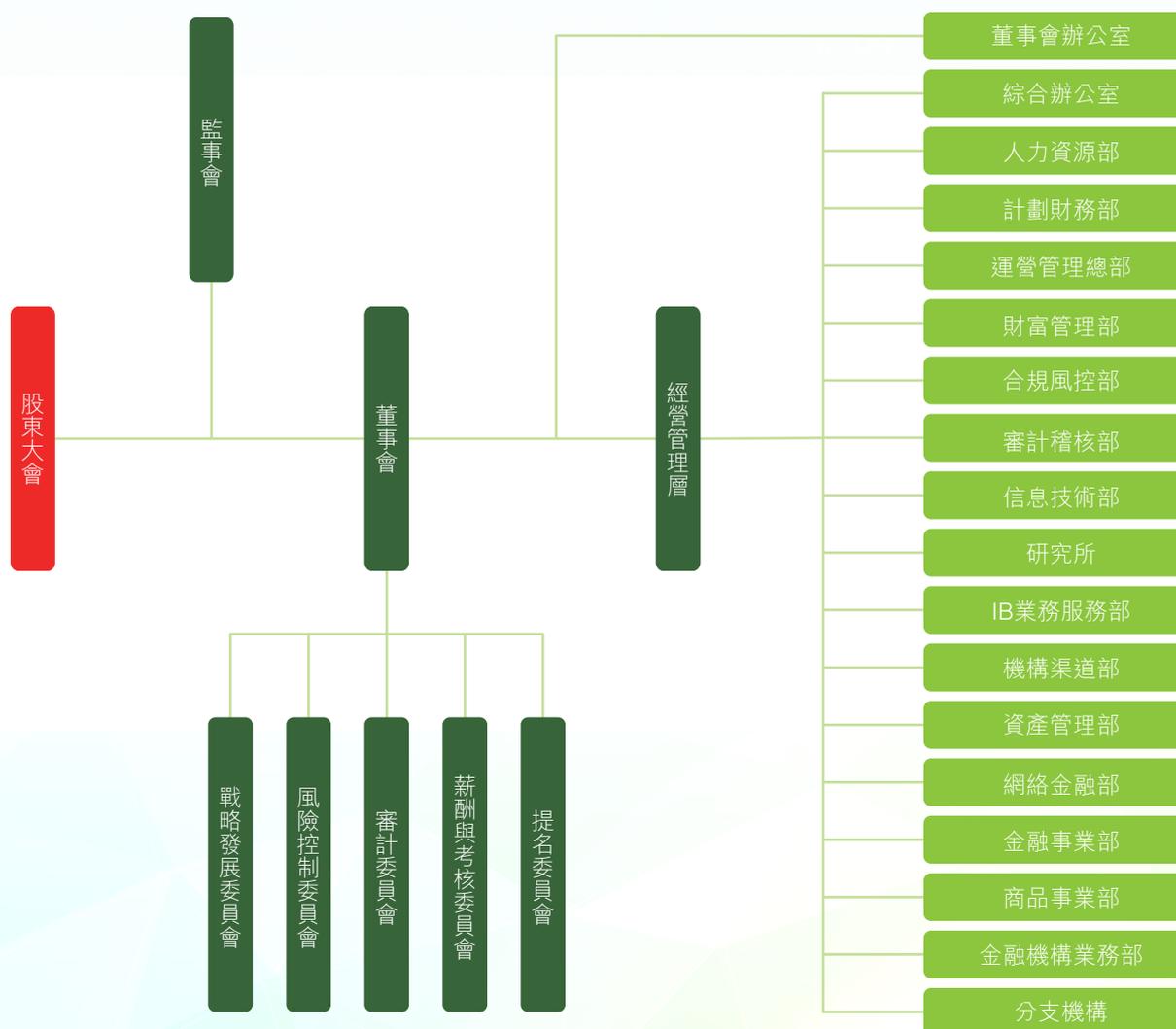
在形成環境、社會及企業管治管理體系與落實環境、社會及企業管治責任的過程中，本集團認識到與利益相關方保持良好溝通的必要性。為此本集團梳理了5個利益相關方的溝通渠道，以保證彼此之間期望和要求的傳達。不僅如此，在開展實際業務過程中，本集團評估了各利益相關方對自身環境、社會及企業管治關注點。

重要利益相關方	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、監管檢查	合規運營 公司治理 遵紀守法 按時納稅 落實國家政策 風險管理
股東及投資者	股東大會、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 風險防控
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
客戶	客戶拜訪、參觀介紹、客戶投訴熱線、宣傳教育、本公司網站	服務質量 客戶權益保護 共同發展 金融專業知識普及 業務流程
社區及公眾	公益活動、結對幫扶、宣傳教育、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

三、管治

(一) 公司治理

本公司始終致力於提升企業管治水平，將企業管治視為為股東創造價值不可或缺的一部分，本公司參照《企業管治守則》所載的守則條文，建立了由股東大會、董事會、監事會及經營管理層組成的有效制衡、獨立運作的現代公司治理架構，使各層次在各自的職責、權限範圍內，各司其職，各負其責，確保本公司規範運作。根據香港聯交所要求，董事會制定了多元化政策，選擇董事人選時將從包括但不限於性別、年齡、文化和教育背景、種族、行業經驗、技術及專業技能及／或資格、知識、服務期限長短等元素考慮。本公司也已採納《企業管治守則》作為本公司的企業管治依據。截至本報告日期，本公司組織架構圖如下：



三會召開情況

股東大會 **1** 次

董事會會議 **14** 次

監事會會議 **3** 次

董事會各專門
委員會 **10** 次

共審議、審閱議案
71 項目

董事會人員構成



董事履職情況

董事會按照《公司章程》的規定行使職權，以本公司及股東的最大利益為原則，向股東大會報告工作，執行股東大會的決議，對股東大會負責。

董事會會議應當由二分之一以上的董事出席方可舉行。除《公司章程》另有規定的情況外，董事會作出決議，必須經全體董事的過半數通過。董事會會議，應當由董事本人出席，董事因故不能出席，可以書面委託其他董事代為出席董事會。董事與董事會會議決議事項所涉及的企業有關連關係的，不得對該項決議行使表決權，也不得代理其他董事行使表決權。該董事會會議由過半數的無關連關係董事出席即可舉行，董事會會議所作決議須經無關連關係董事過半數通過。出席董事會的無關連關係董事人數不足三人的，應該將該事項提交股東大會審議。

報告期內，董事參加董事會和股東大會情況如下：

董事姓名	參加董事會情況						參加股東大會情況
	出席董事會次數	現場出席次數	以通訊方式參加次數	委託出席次數	缺席次數	是否連續兩次未親自參加會議	出席股東大會的次數
執行董事							
鐘金龍	14	2	12	0	0	否	1
梁中偉	14	2	12	0	0	否	1
非執行董事							
劉洪松	14	1	12	1	0	否	0
胡開南	14	2	12	0	0	否	0
明鋼	14	0	14	0	0	否	0
劉峰	14	0	14	0	0	否	0
獨立非執行董事							
高竹	14	0	14	0	0	否	1
王傳順	14	0	14	0	0	否	1
李大鵬	14	0	14	0	0	否	1
鄭堅平	14	0	14	0	0	否	0
年內召開董事會次數							14
其中：現場表決次數							2
通訊表決次數							12
年內召開股東大會次數							1

董事培訓情況

本公司高度重視董事的持續培訓以確保他們對本公司的運作及業務有適當的理解，確保他們了解中國證監會、香港聯交所、香港公司條例、香港公司(清盤及雜項條文)條例以及《公司章程》等相關法律及監管規定所賦予的職責。報告期內，本公司建立了多層次的信息溝通機制，搭建了信息交流平台，加強了董事、監事和高級管理人員之間的信息共享及溝通，提高了董事的履職能力。

報告期內，本公司董事的具體培訓情況如下：

董事姓名	日期	持續時間	組織者	內容
鐘金龍	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
梁中偉	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
劉洪松	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
胡開南	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
明鋼	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
劉峰	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
	2020年11月18日－ 2020年11月24日	16小時	山東上市公司協會	上市公司董事培訓
高竹	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
王傳順	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
	2020年11月18日－ 2020年11月24日	16小時	山東上市公司協會	上市公司董事培訓
李大鵬	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓
鄭堅平	2020年3月26日	4小時	本公司	董事合規培訓

經營管理層履職情況

本公司經營管理層，在總經理的領導下，負責執行董事會作出的各項決議，組織本公司的日常經營管理。按照年初工作部署，經營管理層努力推進各項工作，取得了一定成績，本公司發展得到社會各界充分肯定。

全面深化基礎管理，
夯實發展內功

經紀業務下滑局面
扭轉，呈現持續向好
發展態勢

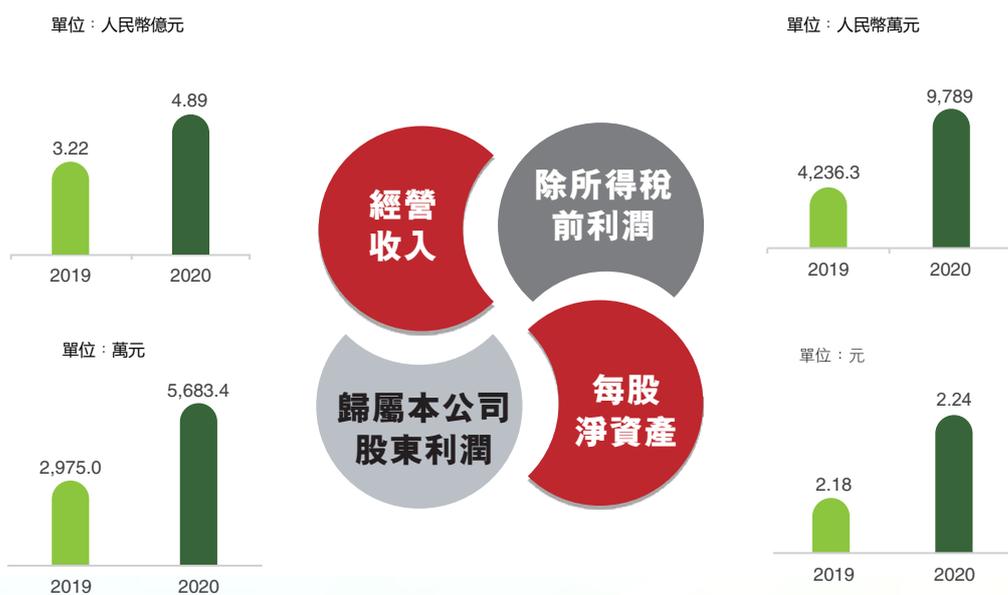
互聯網業務轉型
意識增強，
轉型效果初顯

場內期權及場外業務
持續保持行業領先地位

研究與技術支撐，
運營管理、
合規風控保障能力
持續提升

主要業績指標對比

項目	2019年	2020年	本期比上年同期增減
經營收入(人民幣億元)	3.22	4.89	51.87%
除所得稅前利潤(人民幣萬元)	4,236.3	9,789	149.96%
歸屬本公司股東利潤 (人民幣萬元)	2,975.0	5,683.4	91.04%
每股淨資產(元)	2.18	2.24	2.75%



(二) 合規經營

報告期內，本公司將嚴抓風險防控基本要求嵌入本公司業務流程、風險管理、內控之中，通過充實合規風控力量，優化合規風險管理工作機制、推進風險處置化解、有效發揮風險限額管理、輿情監控等各類工具的作用，嚴抓內控管理，取得積極成效。

重視反洗錢工作，履行反洗錢義務

本公司嚴格按照國家反洗錢法律法規、監管規定，以及本公司《反洗錢內控制度》等相關要求，遵循「風險為本」的工作理念，有序開展各項反洗錢工作，持續優化本公司反洗錢工作及考核機制，認真履行客戶身份識別、客戶風險等級劃分、大額和可疑交易報告、反洗錢工作資料保存等反洗錢法定義務，本公司反洗錢組織機構運行良好。通過完善制度，進一步明確了本公司洗錢風險管理組織架構和工作策略。本公司對反洗錢工作相關流程設計和監測進行了優化調整，針對洗錢風險自評估、大額交易和可疑交易報告、反洗錢工作重大風險應急預案等方面的制度流程進行了補充和完善，加強了反洗錢考核和問責機制，明確將反洗錢工作納入考核和責任追究範圍，提升了洗錢風險管理水平。

本公司通過賬戶管理系統及櫃檯系統實現對客戶身份識別資料和交易記錄的採集、管理和保存，配備了「反洗錢合規管理系統」，確保本公司反洗錢工作的平穩、有序開展。

報告期內，根據人行執法檢查接口規範相關要求，本公司進行了反洗錢系統相關的配套改造，完成了對反洗錢合規管理系統前台部分功能模塊和後台數據處理任務的開發和接口改造工作，完善了執法檢查數據管理功能模塊。此外，為進一步提高系統異常交易監測的有效性，本公司結合近兩年期貨市場採用程序化交易策略的機構客戶顯著增多這一特徵，特別針對「疑似對敲交易」的監測指標閾值進行了調整和優化。

反洗錢知識
線上答題活動
累計參與人數
約4,980人次

面向全體員工
開展線上反
洗錢實務培訓
課程4次，累計
完成課程達
1,713人次；面向
合規風控人員
開展現場反洗錢
實務培訓1次

開展線上反洗錢
宣傳9次，累計
宣傳受眾人數
21,700餘人

反貪污

報告期內，本公司圍繞服務經營發展，嚴監督促合規、抓預防保廉潔，為促進合規展業、廉潔從業、規矩執業提供了堅強的監督保證。

- **強化廉潔從業管理**

本公司重新修訂《廉潔從業管理辦法》，明確了廉潔從業「六自律」、「八嚴禁」及「二十不准」要求；修訂了《黨風廉政建設責任制考核辦法》，確保合規展業、廉潔從業有據可依、有制可循。

• 強化廉潔責任落實

本公司自上而下層層簽訂《全面從嚴治黨主體責任書》、《黨風廉政建設「一崗雙責」責任書》及《黨風廉政建設監督責任書》，誰主管誰負責、一級抓一級、層層抓落實；編製落實紀律檢查「兩年全覆蓋」規劃；組織開展崗位廉潔風險防控排查，評估風險，科學預控。

• 強化廉潔警示教育

本公司堅持定期開展廉潔警示教育，組織觀看廉潔警示教育片10場次，受教育500多人次；舉辦《廉潔從業專題黨課》、赴山東能源棗礦集團開展現場廉潔警示教育、組織開展「迎兩節•守廉潔」廉潔書畫創作活動、組織新入職、轉崗及提拔人員簽訂廉潔從業承諾書、圍繞重大節假日及重要節點加大執紀監督，及時印發廉潔過節通知，並編製了《貫徹落實中央八項規定精神解讀手冊》。

• 強化監督檢查能力

本公司建立落實紀檢工作例會制度，加強交流溝通，分享工作經驗，採取輪流交流發言形式，系統學習解讀黨紀黨規政策、黨風廉政建設相關要求及違紀問題案例，增強監督檢查履職本領；堅持以考促學、學以致用，採取「現場+網上」相結合方式組織紀檢專業知識測試，促進監督檢查素質持續增強。

重視知識產權保護

本公司嚴格遵守《中華人民共和國廣告法》、《中華人民共和國商標法》以及《互聯網廣告管理暫行辦法》等法律法規的要求，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。本公司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，在業務發展和經營管理中注重防範知識產權侵權風險，報告期內未發生重大知識產權侵權事件。

加強資金安全管理

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》、《期貨公司保證金封閉管理辦法》等監管條例規定，制定了《資金管理辦法》、《客戶保證金安全存管管理辦法》、《自有資金投資實施管理辦法》等內控制度，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。

本公司所有投資行為符合國家有關法律法規及產業政策，符合本公司長遠發展計劃和發展戰略，有利於拓展主營業務，有利於本公司的可持續發展，有利於提高本公司的整體經濟利益。

持續保障信息系統安全

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《魯証期貨股份有限公司信息系統安全管理制度》、《魯証期貨股份有限公司網上交易安全管理辦法》及《魯証期貨股份有限公司網絡與信息安全事件應急預案》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。

金融科技賦能數字化轉型

本公司十分重視信息技術發展對業務的推動支撐作用，明確了「以客戶為中心」，信息技術服務於業務、服務於內部效率提升的主題，在金融科技賦能方面持續開展各項工作。

成立IT治理委員會

- 負責制定、審議金融科技應用發展規劃

設立信息技術子公司

- 以開發創新能力為金融科技應用及數字化轉型提供技術支持

制定信息技術中長期規劃

- 明確金融科技發展方向，推動金融科技落地應用

金融科技應用成果

掌上營業廳

- 魯証金融手機應用程式（「APP」），結合人臉識別、電子簽章等科技創新，為客戶提供賬戶激活、密碼清密、結算銀行卡管理等12個業務流程線上化辦理，通過手機即可辦理業務，提升了客戶服務體驗

投研中心與 機器人流程 自動化（RPA）

- 對市場各品種的研究報告、投資策略等研究成果線上化，為客戶提供智能投資參考、市場動態分析等多樣化服務
- 客戶風險承受能力與投研產品風險等級相匹配，客戶僅能查看與其風險承受能力測評結果相匹配的投研產品
- 開展自動化運維及機器人流程自動化（RPA）業務的產品部署，實現運維管理自動化、可視化、及業務流程作業的自動化，提升整體運維管理水平

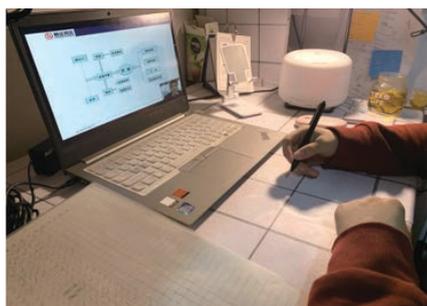
業務中台與 大數據建設

- 開展業務中台系統建設，建設以客戶為中心的統一業務中台系統，構建賬戶統一、操作統一、流程統一、內控統一、審批統一的「五個統一」
- 有效解決信息系統的業務相互割裂的現狀，實現各類業務的高度統一和協同，支持敏捷響應客戶的實際需求
- 開展大數據平台建設，實現數據資產化，提高數據共享水平
- 為上層各種數據查詢、數據分析等提供更高效便捷標準的數據接口支持

重視投資者權益維護

本公司根據《期貨投資者教育工作指引》及《證券期貨投資者適當性管理辦法》等監管條例規定，結合本公司實際情況，修訂了《魯證期貨股份有限公司投資者教育制度》，從制度抓落實，將投資者教育工作落到實處。積極組織開展豐富多彩的投資者教育活動，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。

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；為普及期貨知識，推動投資者教育納入國民教育體系，本公司聯合哈爾濱工業大學(威海)、山東師範大學、山東財經大學、齊魯工業大學四所高校共舉辦了8場「期貨知識進校園」活動。向青年群體開展了投資者教育和保護工作，進一步提升投資者保護的滲透力、輻射力和影響力。



聯合四所大學舉辦「期貨知識進校園」活動

本公司發揮自媒體運營優勢，改進線上投教工作，網上客戶服務能力顯著增強。報告期內，本公司共製作投教圖文2,000餘條，短視頻200餘個、音頻100餘個，被媒體宣傳引用共50餘次，開展特色專題投教活動20餘場，通過線上線下相結合的方式開展投教培訓及調研活動328場，覆蓋投資者全年近500萬人次。

87.20

70.74

56.36

64.55

77.16

29.28

「賞鵲華煙雨·走健康之路」金融知識宣傳健步走活動

24.56



3·15老年人金融消費者(投資者)權益保護宣教活動



以投教為主題的原創流行歌曲
《守護—魯證期貨投資者保護之歌》

本公司積極發揮投資者教育基地作用，始終堅持公益性、專業性、特色性原則，作為山東首批省級互聯網投教基地，始終以客戶需求為出發點，進行更加客觀、專業的投資者教育。幫助投資者集中、系統、持續、便利地獲取期貨知識，認識投資風險並掌握風險防範措施，知悉權利義務，增強自我保護能力，從而提高投資者風險意識，培育理性健康的投資文化。投教基地發揮自身優勢，與交易所、協會及當地監管部門加強合作，積極配合組織開展「反洗錢」、「防非宣傳月」、「金融知識宣傳月」等各項宣傳活動，結合本公司實際情況，通過線上線下相結合的方式積極組織開展了一系列豐富多彩的投資者教育公益活動。

12.87

33

97.50



舉辦「寶寶說期貨」活動



「理性投資防金融詐騙」投資者教育進校園活動



流動課堂投教專線—投教鑼鑼車

提升客戶滿意度，保護客戶隱私安全

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。

本公司積極推進互聯網業務轉型，大力開展金融科技在客戶開發與服務方面的應用，打造線上客服體系；積極構建客戶服務體系，在客戶諮詢、回訪、服務等工作環節，將客戶需求放至第一位，及時為客戶提供優質服務、解決客戶難題，通過與客戶的交流，不斷優化本公司制度流程，打造以客戶為中心的服務體系。

處理客戶電話業務**32,255**次

回訪客戶**5,259**次

客戶滿意率達**99.13%**

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《魯証期貨股份有限公司經紀業務客戶檔案管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司資產管理業務檔案管理辦法》、《魯証期貨股份有限公司資產管理業務保密辦法》、《魯証期貨股份有限公司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數據，本公司設置了檔案保管部門及數據調閱流程，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。



四、環境

本集團屬於低能耗、輕污染的金​​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。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。

(一) 綠色運營與踐行環保

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；鼓勵使用視頻會議系統減少出差率、合理安排本公司商務用車等，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，本集團員工於2020年積極採用電子化辦公流程和制度處理工作事宜；積極採用電話會議或者視頻會議，以減少非必要出差頻率。

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。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及社會企業文化，推動在本集團範圍內節能減排。

(二) 2020年環境績效指標

由於數據的可得性和準確性，本報告中的環境績效指標統計範圍包括本公司總部、魯証資本及魯証信息技術¹。

排放物

指標名稱	單位	2019年數據	2020年數據
溫室氣體排放總排放量 ²	噸	310.14	263.09
人均溫室氣體排放	噸/人	1.09	0.89
直接排放(範圍1)	噸	12.05	10.22
汽油產生溫室氣體總量	噸	12.05	10.22
人均汽油產生溫室氣體	噸/人	0.04	0.03
間接排放(範圍2)	噸	298.09	252.87
電力消耗產生溫室氣體總量	噸	298.09	252.87
人均電力消耗產生溫室氣體	噸/人	1.05	0.86
產生生活污水 ³	噸	1,585.25	2,177.19
人均產生生活污水排放	噸/人	5.58	7.38
產生有害廢棄物 ⁴	噸	0.47	0.40
人均產生有害廢棄物	噸/人	0.002	0.0014
產生無害廢棄物 ⁵	噸	0.75	0.64
人均產生無害廢棄物	噸/人	0.003	0.0022

¹ 該統計範圍，報告期末員工總數為295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。

³ 參考《國家標準城市排水工程規劃規範》，取0.85作為排污係數折算得出。

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。

本集團主要有害廢棄物排放為直接使用化石能源—汽油，造成的硫氧化物的排放，本集團採購商務用車和本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》，採購環保達目標汽車和汽油，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。

資源使用

指標名稱	單位	2019年數據	2020年數據
直接能源消耗	升	5,932	5,032
汽油消耗量	升	5,932	5,032
人均汽油消耗量	升/人	20.89	17.06
間接能源消耗	千瓦時	918,790	811,777.39
辦公用電	千瓦時	918,790	811,777.39
人均辦公用電消耗量	千瓦時/人	3,235.18	2,751.79
辦公複印用紙及報紙總量	噸	0.75	0.8
人均辦公複印用紙及報紙消耗量	噸/人	0.003	0.0027
耗水量	噸	1,865	2,561.40
人均耗水量	噸/人	6.57	8.68
硒鼓消耗量	個	257	182
新換	個	92	65
充粉	個	165	117
人均硒鼓消耗量	個/人	0.9	0.62

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。

(三)從細節做起落實節能減排

本集團積極倡導並踐行環境保護理念和綠色發展理念。

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，宣傳本公司新聞，傳達政策法規，分享研究報告，規範業務流程，內部郵件往來等功能，極大地提高管理效率，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。經本公司辦公室不定期巡查，2020年未發現水資源過度使用和浪費情況。

本公司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。採用本公司車輛及駕駛員的集中管理、統一調配，提高車輛使用效率，並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，本公司車輛全部封存，分支機構也需提供本公司車輛封存證明資料。本公司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。

報告期內本公司並未發生環境事故，亦未因環境污染收到任何投訴、處罰及制裁。



五、社會

(一) 僱傭管理

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》所簽署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，保障員工享有公平的晉升機會。員工入職時與本集團簽訂勞動合同，並且員工的工作時間符合有關法律法規的要求。本集團充分尊重員工的合法權益，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，會根據相關法律法規的要求，履行提前告知義務。



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。

員工僱傭績效指標

	指標	單位	2019年數據	2020年數據
員工總數 ¹		人	519	530
按性別劃分	男性	人	332	333
	女性	人	187	197
按僱傭類型劃分	合同制員工	人	519	530
	其他	人	0	0
按年齡組別劃分	30歲以下	人	152	167
	31歲-35歲	人	158	152
	36歲-40歲	人	104	106
	41歲-45歲	人	51	55
	45歲以上	人	54	50
按受教育程度劃分	碩士研究生及以上	人	124	120
	大學本科	人	324	343
	大專及以下	人	71	67
勞工歧視事件數		件	0	0
勞動合同簽訂率		%	100	100

¹ 統計口徑為本集團所有員工總數。

員工薪酬福利

本集團員工薪酬由基本工資、績效工資、獎金、地區補助、學位津貼、業務提成、外派補助、特殊津貼和保險福利構成。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、獎金是根據各部門和員工績效考核結果發放的浮動薪酬；業務提成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、住房公積金、企業年金計劃，有關社會統籌保險、住房公積金和企業年金按照屬地化原則進行管理。

員工福利保障體系

基本福利

- 五險一金

健康與關懷

- 員工互助基金
- 生日關懷、節日慰問
- 主題教育活動
- 健康體檢

長期保障

- 企業年金計劃

87.20

70.74

56.96

64.55

77.16

積極培養、吸納金融人才

95.92

29.28

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，本公司招錄國內外重點院校應屆畢業生16人，社會招聘67人，其中社會招聘超過60%來自於期貨、證券、銀行、基金等金融機構。本公司積極溝通省市級人才服務局、金融工作辦公室等部門，加深高校合作，參加山東省及濟南市人才服務局組織的校園招聘活動，並積極獨立組織多次校園招聘宣講活動。按照產學研相結合的社會需求，積極吸納高校學生進入本集團鍛煉實習，提升學生實踐能力，增強學生就業競爭力，報告期內，共計吸納14名高校學生進入本集團鍛煉實習。



(二) 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。

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，為員工按照最高繳納比例辦理住房公積金，並為員工繳納企業年金。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、產假和陪產假。



本公司以職代會為載體，及時反映員工心聲，調動員工的積極性和創造性，為本公司了解員工參與企業管理、集中員工集體智慧搭建堅實平台。通過職代會保障了員工群眾知情權、參與權、表達權、監督權。同時，本公司主動接受員工群眾的監督、鼓勵廣大員工圍繞本公司的發展大局提出合理化建議，為本公司的發展建言獻策。

本公司通過工會積極維護員工基本權益，為員工提供基本福利。近3年以來，本公司在員工生日以送鮮花和生日蛋糕等形式為員工送去生日祝福1,500多次；在春節、中秋等重要節日累計為員工發放福利人民幣150萬元；在員工遇到親人病故、生病等情況，工會主動進行慰問10餘次。同時，為幫助員工解決實際困難，進一步完善困難員工救助體系，本公司工會制定了《職工互助基金管理辦法》。

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。疫情期間堅決做好疫情防控工作，積極落實主體責任，在保證金融安全、人民安全的前提下，採取靈活辦公方式，持續做好疫情監測和重點區域消殺工作。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。

2020年4月，為貫徹落實習近平總書記重要指示精神，提高本集團全體員工和投資者的國家安全法治意識，營造維護國家安全的濃厚法治氛圍，增強防範和抵禦安全風險能力，在「4·15全民國家安全教育日」來臨之際，本集團組織開展普法宣傳活動。

報告期內，本集團組織多次安全生產檢查。

87.20

70.74

56.96

64.55

77.16

員工權益績效指標

95.92

29.28

指標	單位	2019年數據	2020年數據
社會保險覆蓋率	%	100	100
因工作關係死亡的員工數	人	0	0
工傷發生率	%	0	0
因工作損失的工作日數	天	0	0

組織豐富的文體活動

為凝聚全體員工奮鬥力量，本公司組織開展了多項層次不同、規模不一、類別多樣、覆蓋面廣的文體活動。



創新開展「塑造陽光心態，打造最強戰隊」主題職業素養拓展活動



組織參加山東資本市場「走向百年輝煌」歌詠比賽，榮獲「一等獎」、「三等獎」、「優秀組織獎」





組織參加中泰證券春晚節目匯演，
榮獲「優秀組織獎」



與中泰證券共同搭建網絡平台，組織開展了貫通全年的「朗讀比賽」活動四次



舉辦2020年「禮讚新時代，起航新徵程」
新春聯歡會



組織參加「中泰證券司歌傳唱比賽」，
榮獲團體「二等獎」

87.20

70.74

56.96

64.55

77.16



開展慶祝「三八婦女節」線上慰問活動



積極參加山東省總工會「時代新人說」職工演講比賽，本公司扶貧作品受到社會各界一致好評

各項活動的成功舉行，在本公司內掀起全民健身的熱潮，激發了本公司員工頑強拚搏、積極進取的意識，增強本公司凝聚力，擴大對外宣傳力度，提升本公司品牌建設能力。



(三)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，共組織大型培訓項目7次、日常培訓71次、協會交易所直播培訓41次、全員讀書活動1次，內容包括新業務新品種、期權、網絡金融、信息技術、財務、合規風控、廉潔從業、公司文化、領導力提升、崗位技能提升等方面。E-Learning平台製作微課程78節，進一步豐富了本公司課程體系。組織學習測試16場，檢驗學習成果。

培訓圍繞著員工工作需要、業務發展需求展開，採取多樣化的培訓方式，針對不同類別、不同層次的人才分級、分類組織開展。**一是**注重公司文化、廉潔從業、合規執業的宣傳宣導，落實到日常培訓及專項培訓中，組織年度職業素養拓展培訓，與公司工會共同舉辦，幫助員工塑造陽光心態，打造最強戰隊，組織2020年度新員工培訓啟航計劃，幫助新員工快速融入公司文化，樹立統一的企業價值觀；**二是**在疫情期間，積極創造條件，發力線上培訓，突破疫情帶來的管理困境，組織針對中高層的即學即戰贏回時間中高層領導力訓練營、針對經營主體負責人的專項線上交流培訓；**三是**持續開展員工崗位技能提升培訓，組織針對公司各崗位人員的崗位勝任能力系列培訓、針對財務人員的年度財務專題培訓、針對合規風控崗的年度專項培訓以及分支機構負責人高績效團隊建設培訓。通過打磨培訓內容、創新培訓形式、跟進培訓效果，營造有利於員工學習、提高素質的良好氛圍，培養員工的學習自覺性和學習能力。

87.20

70.74

56.96

64.55

77.16



2020年度新員工培訓(啟航計劃)



2020年度合規風控崗專項培訓

12.87

33

97.50



已完成

2.自我管理：为自己营造一个职场

2.自我管理：为自己营造一个职场

公司课程

★★★★★

122 人在学

免费



已完成

1.自我管理：越是艰苦的环境，越需要保持状态

1.自我管理：越是艰苦的环境，越需...

公司课程

★★★★★

123 人在学

免费



已完成

14.自我成长：当所谓的“危机”成为常态

14.自我成长：当所谓的“危机”成为...

公司课程

★★★★★

118 人在学

免费



12.团队管理：点对点沟通不可少

12.团队管理：点对点沟通不可少

公司课程

★★★★★

117 人在学

免费



已完成

5.自我管理：让工作变得有意义

5.自我管理：让工作变得有意义

公司课程

★★★★★

117 人在学

免费



已完成

4.自我管理：保持注意力和工作强度

4.自我管理：保持注意力和工作强度

公司课程

★★★★★

117 人在学

免费



15.自我成长：如何做到未雨绸缪

15.自我成长：如何做到未雨绸缪

公司课程

★★★★★

119 人在学

免费



13.团队管理：分享积极信息

13.团队管理：分享积极信息

公司课程

★★★★★

116 人在学

免费



11.团队管理：让任务推进迅速

11.团队管理：让任务推进迅速

公司课程

★★★★★

117 人在学

免费



已完成

3.自我管理：杜绝不必要的干扰

3.自我管理：杜绝不必要的干扰

公司课程

★★★★★

120 人在学

免费



10.团队管理：让文档变得简洁

10.团队管理：让文档变得简洁

公司课程

★★★★★

120 人在学

免费



8.团队管理：让团队充满目标感

8.团队管理：让团队充满目标感

公司课程

★★★★★

116 人在学

免费

即學即戰贏回時間中高層領導力訓練營

員工培訓指標

	指標	單位	2019年數據	2020年數據
按性別劃分的受訓僱員百分比	男性	%	64.4	62.8
	女性	%	35.6	37.2
按僱員類別劃分的受訓僱員百分比	高級管理層	%	2.2	2.3
	中級管理層	%	14.2	12.6
	基層員工	%	83.6	85.1
按性別劃分的僱員受訓平均時數	男性	小時/人	43.27	25.4
	女性	小時/人	47.25	42.9
按僱員類別劃分的僱員受訓平均時數	高級管理層	小時/人	24	24
	中級管理層	小時/人	36	36
	基層員工	小時/人	48	48



(四) 供應鏈管理

由於業務性質，本集團作為金融機構，主要的供應商類型包括律師事務所、會計師事務所、資產評估機構、信息科技公司及辦公用品供應商等。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，以及在過往經營中有無違法、違規和重大法律糾紛，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。

專題一：眾志成城，助力疫情防控

報告期初，一場突如其來的新冠肺炎疫情（「疫情」）牽動著億萬中國人民的心，社會各界紛紛投入到抗擊疫情的行動中。疫情就是命令，防控就是責任。抗疫戰役打響以來，本公司積極響應國家號召，堅決貫徹上級決策部署，於2020年2月成立了疫情防控工作領導小組和工作小組，統籌協調本公司疫情防控工作。疫情期間，本集團發揮專業優勢，積極助力實體企業復工復產；全力保障經營活動正常進行，切實保護投資者權益；積極投身到關愛員工健康與安全、愛心捐款活動中，用愛、用心馳援抗疫一線，積極助力打贏疫情防控阻擊戰，為疫情防控貢獻力量。

積極開展愛心捐款

2020年1月，本公司作為初始發起人之一的山東中泰慈善基金會向湖北省慈善總會捐贈人民幣600萬元，用於疫情防控和救治。

2020年2月，本公司向國家級貧困縣湖北省紅安縣、英山縣、羅田縣各捐款人民幣10萬元，共計人民幣30萬元用於以上三縣的疫情防控和救治。

2020年2月，本集團開展「抗擊疫情」愛心捐款活動，員工積極響應，紛紛伸出援助之手，為疫情防控工作盡一份綿薄之力，以實際行動詮釋責任與擔當，為疫情防控紓困解難，活動共募集人民幣149,418元的愛心捐款。

主動投身抗疫一線

面對大連金普社區「12.15」疫情，本集團員工主動報名參加大連憬園社區防疫志願者隊伍，投身疫情防控第一線。不怕困難，擔當作為，每天堅持在崗在位，和社區工作人員一起出色地完成了外來人員排查、出入人員登記、體溫測量、消毒消殺、定菜送藥等工作，收到了社區和廣大群眾的一致認可和廣泛稱讚，為大連疫情防控工作貢獻了一份自己的力量。

助力實體企業復工復產

本集團在做好自身疫情防控工作的同時，充分發揮自身專業優勢，運用金融衍生工具為實體企業應對疫情風險提供場外解決方案。根據不同企業不同時段的不同風險點，為實體企業量身定做場外期權方案，積極配合實體企業處理突發風險，把握潛在機會，保障實體企業有序復工，把疫情帶來的影響降到最低。

本集團場外業務團隊現場拜訪客戶，了解到客戶在未來一個月將購入PVC（聚氯乙烯）現貨，為規避價格上漲風險，本集團為客戶設計了領式看漲期權組合，有效幫助客戶降低了套保成本。

本集團客戶參與管道項目招標，招標規則為價低者得，本集團場外業務團隊精準判斷PVC價格會繼續上漲，為客戶設計賣出看跌期權策略，通過策略進而壓低標價增加客戶中標概率，使得客戶成功競標。

本集團PTA（精對苯二甲酸）產業客戶想在盤面建立PTA的常備庫存，以滿足經營目標，傳統做法是在接下來一個月內擇機在期貨盤面進行買入期貨頭寸，此操作面臨盤面價格劇烈波動和人為操作不當錯失開倉時機的風險。本集團場外業務團隊根據客戶需求設計了累計期權在盤面動態建立PTA期貨多單的策略，成功幫助客戶以低於盤面的價格建立了虛擬庫存，同時規避了不必要的人工操作風險。

報告期內，本集團承辦「穩企安農，護航實體」—大宗商品風險管理(山東)論壇菜系分論壇及大宗商品風險管理線上圓桌論壇(第4期)等多場次鄭州商品交易所線上直播論壇會議。

堅持提供優質客戶服務

在落實落細疫情防控工作的同時，本公司積極採取措施滿足投資者的服務需求，保障了經營活動的正常進行，切實保護了投資者權益。

本公司充分發揮線上服務的展業優勢，引導客戶進行線上業務辦理，通過召開互聯網業務開發與客戶服務的專題培訓視頻會，指導全體員工在疫情防控期間充分利用本公司互聯網平台，合規、有效的做好線上開發及服務工作。

本公司督導分支機構積極推廣「魯証金融」APP，引導客戶通過網絡和手機APP辦理業務和交易，盡可能減少現場業務辦理。針對疫情期間可能出現的行情波動加劇等情況，要求分支機構提前制定應急預案，及時與客戶溝通，做好交易服務和風控處置。

保障員工健康與安全

本公司在疫情防控中始終堅持以人為本，優先考慮本公司員工的身心健康與安全，採取多種措施避免人員聚集，防止交叉感染，讓員工在安全的環境中辦公。報告期內，本公司未發生聚集性疫情感染事件。

疫情期間，本公司辦公場所均提前做好了全方位消毒處理和通風工作，並配備了口罩、消毒、測體溫等防護用具，保障員工需求。

在疫情緩解、全面復工前，本公司要求各單位在保證經營穩定的情況下，實行輪班制，確保交易、結算、風控等關鍵崗位不空缺，日常工作能夠運轉。

員工每日上班前進行體溫測量，並要求上班期間必須佩戴口罩，做好防護措施。員工出現呼吸道疾病等不適症狀的情況，第一時間安排替班休息。

疫情期間，為保證員工就餐的健康安全問題，避免員工集中到餐廳就餐而帶來的風險，本公司安排專人負責為員工進行盒飯配餐，並派專人將盒飯運送到本公司辦公地點，然後分發給各員工，避免了集中就餐而帶來的風險。



專題二：凝心聚力，打贏脫貧攻堅戰

報告期內，本集團積極貫徹落實黨中央、中國國務院和中國證監會關於扶貧工作的統一部署、響應中國期貨業協會發起的期貨行業服務國家脫貧攻堅戰略行動倡議，積極傳承義利並舉、扶危濟困的文化基因，始終把「兼濟天下」、回饋社會作為本集團義不容辭的責任。本公司先後與6個國家級貧困縣簽訂結對幫扶協議，年度內累計投入扶貧資金人民幣2,000餘萬元參與扶貧活動。在2019-2020年度期貨公司扶貧工作情況考評中，本公司名列前茅，並先後榮獲「最佳精準扶貧及愛心公益獎」及「山東金融業脫貧攻堅最具影響力品牌」等榮譽稱號，本公司專業扶貧案例入選中國期貨行業脫貧攻堅優秀故事集。

專業扶貧

2020年3月，本公司在黑龍江省樺川縣玉米「保險+期貨」縣域全覆蓋項目順利賠付，項目實現賠付金額人民幣8,787.31萬元，賠付率高達376%。項目覆蓋全縣玉米種植面積32.75萬畝，折合現貨量18.34萬噸，為2,555戶玉米種植農戶提供了人民幣952元/畝的收入保障，實現了縣域範圍內「願保盡保」。試點項目總保費人民幣2,338.13萬元(大連商品交易所支持70%、樺川縣政府及農戶共同承擔30%)，保險保障金額達人民幣3.12億元。該項目是本公司繼2018年在樺川縣實施「保險+期貨+基差貿易」縣域全覆蓋試點以來，在該縣首次開展的縣域範圍玉米收入險試點，項目產生的良好效果切實幫助樺川縣實現了真脫貧、不返貧，體現了「保險+期貨」助力貧困地區夯實脫貧成果的有效性。

報告期內，本集團「保險+期貨」專業扶貧取得較大突破，試點規模和影響範圍進一步擴大，開展「保險+期貨」項目共計12個，涉及山東、黑龍江、遼寧、新疆4個省13個縣區，玉米、大豆、棉花、紅棗、雞飼料、雞蛋6個品種，項目總承保規模覆蓋農產品種植面積約90萬畝，保險保障金額達人民幣9.5億元，覆蓋農戶5.8萬戶。其中涉及到貧困地區黑龍江樺川縣、新疆維吾爾自治區麥蓋提縣、黑龍江海倫市項目數量168,546.92噸，名義本金人民幣43,011.43萬元，進一步擴大了扶貧工作影響力。

產業扶貧

2020年10月，本公司向新疆維吾爾自治區麥蓋提縣捐款人民幣50萬元，用於實施麥蓋提縣紅棗「保險+期貨」產業扶貧試點項目，提高了試點工作社會影響力以及試點模式的可複製性和可推廣性。

2020年12月，本公司向安徽省太湖縣進行產業扶貧捐款人民幣10萬元，此筆款項由太湖縣人民政府專項用於劉畝鄉樂盛村茶園覆蓋項目實施，助推太湖縣鞏固脫貧攻堅成果。

消費扶貧

報告期內，本公司優先採購貧困地區農產品作為本公司紀念品，春節、中秋節累計購買新疆維吾爾自治區麥蓋提縣、黑龍江省樺川縣等貧困地區產品70萬元左右，為貧困農戶脫貧盡心盡力。

2020年2月，本集團幫助貧困地區內蒙古省通遼市開魯縣眾誠糧食購銷有限責任公司銷售玉米1,500噸，銷售金額共計人民幣202.77萬元。

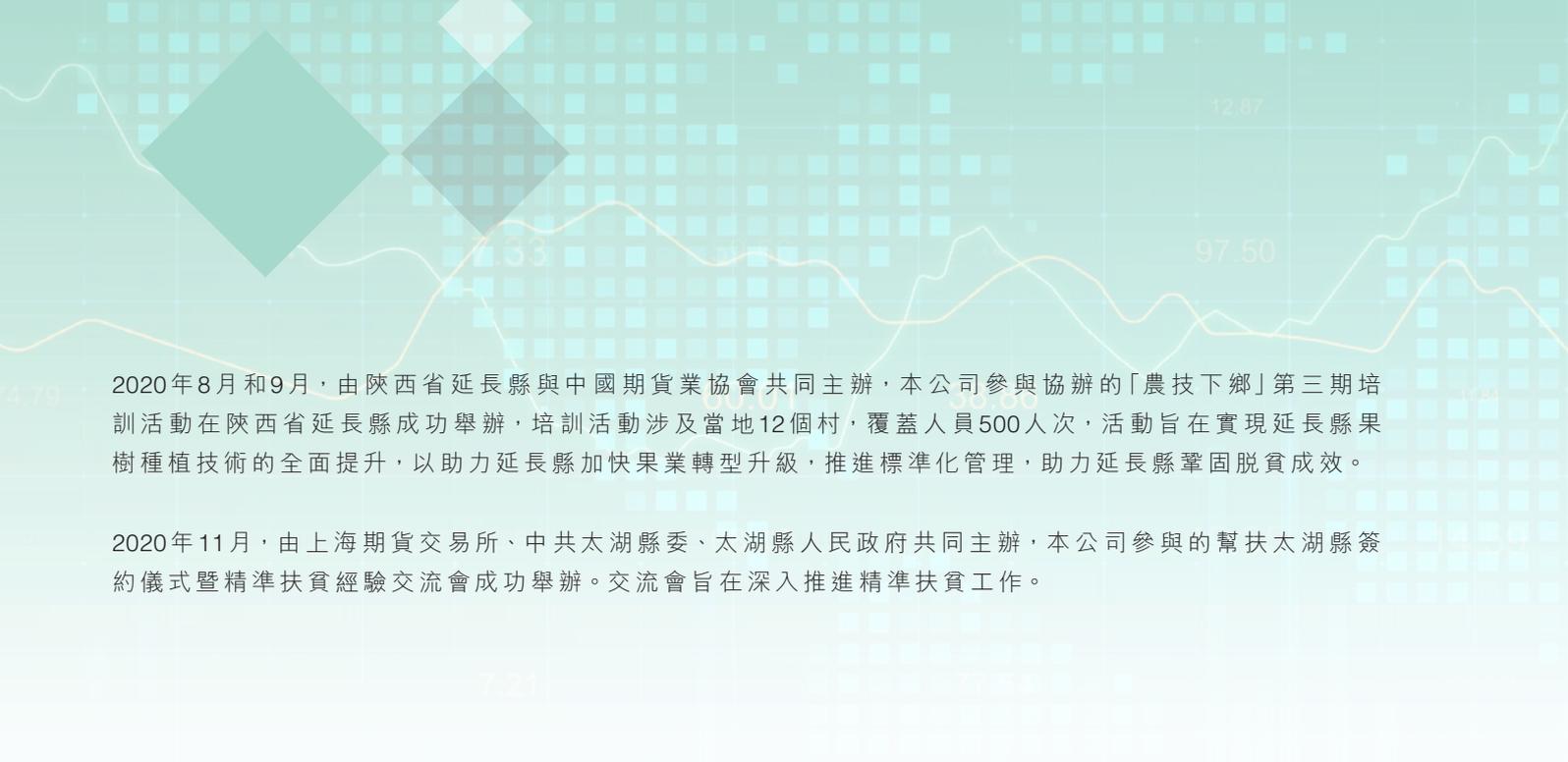
慈善扶貧

2020年2月，本公司與國家級貧困縣湖北省紅安縣、英山縣、羅田縣分別簽署結對幫扶協議，在實施慈善扶貧、專業扶貧、消費扶貧等領域開展合作，全方位支持當地脫貧攻堅，推動當地經濟社會健康發展。

其他扶貧

2020年3月和11月，本公司分別與甘肅省秦安縣、河南省桐柏縣簽訂結對幫扶協議，在期貨專業幫扶、產業幫扶、人才幫扶等各方面開展全方位合作，切實履行社會責任，進一步加快貧困地區脫貧步伐。

2020年4月，本集團招聘錄用國家級貧困縣黑龍江省樺川縣殘疾人士1名。



2020年8月和9月，由陝西省延長縣與中國期貨業協會共同主辦，本公司參與協辦的「農技下鄉」第三期培訓活動在陝西省延長縣成功舉辦，培訓活動涉及當地12個村，覆蓋人員500人次，活動旨在實現延長縣果樹種植技術的全面提升，以助力延長縣加快果業轉型升級，推進標準化管理，助力延長縣鞏固脫貧成效。

2020年11月，由上海期貨交易所、中共太湖縣委、太湖縣人民政府共同主辦，本公司參與的幫扶太湖縣簽約儀式暨精準扶貧經驗交流會成功舉辦。交流會旨在深入推進精準扶貧工作。

六、環境社會與企業管制指標對照表 29/28

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		四、(一)綠色運營與踐行環保 四、(二)2020年環境績效指標
A1.1	排放物種類及相關排放數據	四、(二)2020年環境績效指標
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)	四、(二)2020年環境績效指標
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)	四、(二)2020年環境績效指標
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)	四、(二)2020年環境績效指標
A1.5	描述減低排放量的措施及所得成果	四、(二)2020年環境績效指標 四、(三)從細節做起落實節能減排
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	四、(二)2020年環境績效指標 四、(三)從細節做起落實節能減排

12.87

33

97.50

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		四、(一)綠色運營與踐行環保 四、(二)2020年環境績效指標
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)	四、(二)2020年環境績效指標
A2.2	總耗水量及密度(如以每產量單位、每項設施計算)	四、(二)2020年環境績效指標
A2.3	描述能源使用效益計劃及所得成果	四、(二)2020年環境績效指標 四、(三)從細節做起落實節能減排
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	四、(二)2020年環境績效指標 四、(三)從細節做起落實節能減排
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	四、(二)2020年環境績效指標

87.20

70.74

56.36

64.55

77.16

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		四、(三)從細節做起落實節能減排
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	四、(三)從細節做起落實節能減排
範疇B：社會		
層面B1：僱傭		
一般披露		五、(一)僱傭管理
B1.1	按性別、僱傭類型、年齡組別及地區劃分的僱員總數	五、(一)僱傭管理
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		五、(二)健康與安全
B2.1	因工作關係而死亡的人數及比率	五、(二)健康與安全
B2.2	因工傷損失工作日數	五、(二)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	五、(二)健康與安全
層面B3：發展及培訓		
一般披露		五、(三)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	五、(三)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	五、(三)發展與培訓

12.87

97.50

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		五、(一)僱傭管理
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		五、(四)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、(二)合規經營
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、(二)合規經營
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、(二)合規經營

87.20

70.74

56.36

64.55

77.16

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、(二)合規經營
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、(二)合規經營
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、(二)合規經營
層面B8：社區投資		
一般披露		專題二：凝心聚力，打贏脫貧攻堅戰
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)	專題二：凝心聚力，打贏脫貧攻堅戰
B8.2	在專注範疇所動用資源(如金錢或時間)	專題二：凝心聚力，打贏脫貧攻堅戰



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