

## 厦门港务发展股份有限公司关于贸易公司 2019年度开展套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司于2018年12月28日召开第六届董事会第二十三次会议，会议审议通过了《关于厦门港务贸易有限公司2019年度在保证金陆仟柒佰万元人民币额度内开展套保业务的议案》，同意公司全资子公司厦门港务贸易有限公司（以下简称“贸易公司”）2019年度在保证金6700万元（卖出套保4700万和买入套保2000万）人民币额度内开展商品期货套期保值业务，现将相关情况公告如下：

### 一、套期保值业务的目的

贸易公司开展套期保值业务目的是充分利用期货市场的套期保值功能，以一个市场的盈利来弥补另一个市场的亏损，从而达到规避经营活动中的价格波动风险。

### 二、 预计开展的套期保值业务概述

#### 1、套期保值的交易市场

贸易公司仅限于在境内期货交易所进行场内交易，不进行场外和境外交易；拟进行套期保值交易的现货品种，仅限于在境内期货交易所交易的与贸易公司主营相关的大宗商品。目前贸易公司拟开展套期保值的产品主要为大连商品期货交易所的LLDPE（线性低密度聚乙烯）、PP（聚丙烯）、上海期货交易所的螺纹钢、热卷、纸浆和郑州商品期货交易所的白糖等。

#### 2、期货品种

贸易公司的期货套期保值业务，仅限于公司已持有的，或正在有效履行的购销合同项下的与期货品种同类的产品，限于钢材、白糖、塑料、纸浆等产品范围内。

#### 3、拟投入资金

2019年度内，贸易公司全年期货套期保值保证金额度在人民币6700万元（卖出套保4700万和买入套保2000万）以内的（含追加的临时保证金）。实际执行

过程中，超年度套期保值计划或保证金超过 6700 万元，应重新履行审批程序。

#### 4、资金来源

贸易公司将利用自有资金进行期货套期保值业务。

#### 三、履行合法表决程序的说明

2018年12月28日，本公司第六届董事会第二十三次会议以9票赞成，0票反对，0票弃权审议通过了《关于厦门港务贸易有限公司2019年度在保证金陆仟柒佰万元人民币额度内开展套保业务的议案》。该项套期保值业务不属于关联交易事项，无需履行关联交易表决程序；该议案在董事会权限范围内且以套期保值为目的的衍生品投资，不需提交公司股东大会审议。

#### 四、开展套期保值业务的主要条款

1、业务范围：根据现货需要开展钢材、白糖、塑料、纸浆等期货标准合约的交易，不进行投机；

2、交易品种：只从事钢材、白糖、塑料、纸浆等期货标准合约的交易，不进行场外交易；

3、交易所选择：郑州商品期货交易所、大连商品期货交易所、上海期货交易所；

4、合约的交割：实物交割；

5、交易数量：根据公司业务经营的情况而定，总成交金额不超过7亿元；

6、合约期限：不超过12个月；

7、交易杠杆倍数：按目前价格计算为10倍左右；

8、流动性安排和清算交易原则：根据建立头寸所对应的到期日进行资金方面的准备，并按照期货交易所相应的结算价格进行购入或卖出清算；

9、支付方式及违约责任：出现违约或者交易损失，按现金汇付结算；

10、履约担保：以期货交易保证金方式担保。

#### 五、开展套期保值业务的准备情况

1、贸易公司已制定《厦门港务贸易有限公司期货套期保值业务内部控制制度》，套期保值工作按照以上制度严格执行；

2、贸易公司建立了完善的期货套期保值业务决策、操作、监督等工作分工和控制机制。公司董事会是期货业务的最高决策机构；贸易公司套期保值管理办公室是期货业务的日常管理机构，负责期货业务的日常管理工作，确保相关人员

遵守有关制度；负责制定、执行套期保值交易方案。

#### 六、开展商品期货套期保值业务的风险及措施

1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成投资损失。公司拟将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，同时加强资金管理的内部控制，不得超过公司董事会批准的保证金额度。

3、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。贸易公司将严格按照《期货套期保值业务内部控制制度》等规定进行套期保值操作，建立严格的授权和岗位制度，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。同时建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序。

4、技术风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险。公司将选配多条通道，降低技术风险。

#### 七、期货公允价值分析

公司衍生品交易所选择的交易所和交易品种市场透明度大，成交活跃，流动性较强，成交价格和结算价能充分反映衍生品的公允价值。

#### 八、会计政策及核算原则

公司根据《企业会计准则第22号-金融工具确认和计量》、《企业会计准则第24号-套期保值》对金融衍生品的公允价值予以确定。

#### 九、独立董事独立意见

公司独立董事审议了《关于厦门港务贸易有限公司2019年度在保证金陆仟柒佰万元人民币额度内开展套保业务的议案》，并发表了“同意”独立意见，独立意见有关内容参见2018年12月29日巨潮资讯网《独立董事相关事项独立意见》。

#### 十、备查文件

- 1、经与会董事签字并加盖董事会印章的董事会决议；
- 2、独立董事相关独立意见。

特此公告。

厦门港务发展股份有限公司董事会

2018年12月28日