

证券代码：601677

证券简称：明泰铝业

公告编号：临 2019-024

河南明泰铝业股份有限公司

关于开展铝锭套期保值业务的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

河南明泰铝业股份有限公司(以下简称“公司”)第四届董事会第三十八次会议审议通过了《关于开展铝锭套期保值业务的议案》，同意公司开展铝锭套期保值业务，现将有关情况公告如下：

一、交易背景及交易品种

公司专业从事铝板带箔的生产和销售，主要原材料为铝锭，为避免原材料价格波动带来的影响，公司将通过期货套期保值的避险功能积极规避价格波动风险。

公司开展期货套期保值业务，仅限于本公司生产经营所需原材料铝锭的期货交易合约。

二、套期保值的目的

开展铝锭期货交易，可以充分利用期货市场套期保值的避险机制，降低原材料价格波动风险，达到锁定原材料成本的目的，避免原材料出现大幅波动可能带来的损失，保证产品成本的相对稳定，降低对公司正常经营的影响。

三、投入资金及业务期间

公司在铝锭期货套期保值业务中投入的资金(保证金)全部为自有资金，业务期间为本议案通过之日起至 2019 年年度董事会召开之日。

四、套期保值的风险分析

1、价格波动风险：铝期货合约价格易受基差变化影响，行情波动较大，可能产生价格波动风险，造成期货交易的损失。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金风险。

3、流动性风险：可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

4、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控

体系不完善造成风险。

5、技术风险:可能因为计算机系统不完备导致技术风险。

五、公司拟采取的风险控制措施

1、公司将套期保值业务与公司生产经营相匹配,持仓时间与现货保值所需的计价期相匹配。

2、公司将合理调度自有资金用于套期保值业务,不使用募集资金直接或间接进行套期保值,同时加强资金管理的内部控制,严格控制不超过董事会批准权限。

3、公司将重点关注期货交易情况,合理选择期货保值合约月份,避免市场流动性风险。

4、公司将严格按照有关规定安排,使用专业人员,建立严格的授权和岗位牵制制度,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。

5、公司设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统,保证交易系统的正常运行,确保交易工作正常开展。当发生错单时,及时采取相应处理措施,并减少损失。

6、建立汇报和内审机制,公司的套期保值交易计划应事先向相关业务部门报备,公司业务部门在发现交易计划超出董事会授权范围时应及时通知公司暂停执行,并同时向公司总经理汇报,由总经理决定是否提请召开董事会审批新的授权。

六、备查文件

公司第四届董事会第三十八次会议决议

特此公告。

河南明泰铝业股份有限公司

董 事 会

2019年4月25日