

安徽梦舟实业股份有限公司

2018 年度套期保值资金使用的公告

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。

安徽梦舟实业股份有限公司（以下简称“梦舟股份”或“公司”）是一家以铜板带材的生产和销售以及影视传媒双主业为主营业务的公司。近年来，受国内外宏观经济影响，铜、锌等原材料相关产品市场价格波动较大，为有效规避市场风险，对冲原材料相关产品价格波动对公司生产经营的影响，公司利用期货市场的套期保值功能，进行风险控制，减少和降低原材料相关产品价格波动对生产经营的影响。

一、套期保值业务基本情况

- 1、品种：国内期货交易所上市交易的铜、锌、锡、镍期货；
- 2、交易数量：自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 12 月 31 日止铜期货套期保值的最大持仓量不超过 2 万吨，锌期货套期保值的最大持仓量不超过 0.3 万吨，锡期货套期保值的最大持仓量不超过 100 吨，镍期货套期保值的最大持仓量不超过 100 吨；
- 3、保证金规模：不超过人民币 0.6 亿元；
- 4、目的：有效降低铜、锌现货市场价格波动带来的经营风险，提高企业经营水平和抗风险能力。

二、套期保值业务主要风险

- 1、市场风险

主要表现为基差风险和保值率风险。基差风险指期货市场在一段时期内现货价格与期货价格的差值的变动风险，它直接影响套期保值效果；保值率风险指公司持有的现货资产往往难以与期货对应标的的现货组合完全吻合而产生的风险。

2、政策风险

监管机构如对期货市场相关政策法规等进行修订，有可能短期内导致期货价格波动较大或期货交易不活跃，可能会给公司造成损失。

3、流动性风险

在期货交易中受市场流动性因素的限制，可能会使公司不能以有利的价格进出期货市场。

4、现金流风险

在套期保值过程中，由于暂时的资金不足而导致期货头寸被迫平仓，可能会给公司带来损失。

5、操作风险

内部工作流程、风险控制系统、员工职业道德、交易系统等方面如果出现问题，可能会给公司带来损失。

6、技术风险

由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应风险。

三、风险控制措施

1、资金风险控制

公司由财务部负责资金风险控制：

- 1) 测算已占用的保证金额度、浮动盈亏；
- 2) 测算可用保证金额度及拟建头寸需要的保证金额度、公司对可能追加的保证金的准备额度；
- 3) 每月末与期货经纪公司核对保证金账面余额以及期货合约持仓状况，监控资金的安全。

2、操作风险控制

公司由期货科负责操作风险的控制，当发生下列情况时，立即报告公司总经理

理，同时上报期货研讨小组：

- 1) 当境内期货价格波动较大或发生异常波动的情况时；
- 2) 境内期货业务有关人员违反风险管理政策和风险管理工作程序；
- 3) 当境内期货价格波动与现货价格波动产生较大的偏离值影响到套期保值过程的正常进行。

3、公司合理计划和安排使用保证金，保证套期保值过程正常进行。合理选择保值月份，避免市场流动性风险。

4、期货科每日向分管领导报告当天新建头寸情况、计划建仓及平仓头寸情况、期货保值后当日期现货对锁变动情况及最新市场信息等情况。

5、期货科每月向公司总经理、财务部门及运营管理部报送期货保值业务结算表，包含汇总持仓状况、结算盈亏状况及保证金使用状况等信息。

6、公司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。

7、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。

特此公告。

安徽梦舟实业股份有限公司董事会

2018年4月28日