

河南中孚实业股份有限公司

关于开展 2015 年度铝产品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。

河南中孚实业股份有限公司(以下简称“公司”)第七届董事会第三十七次会议审议通过了《关于开展 2015 年度铝产品套期保值业务的议案》,同意公司开展铝产品套期保值业务,现将有关情况公告如下:

一、交易背景及交易品种

公司专业从事铝产品的生产和销售,为避免原材料价格波动带来的影响,同时降低铝产品销售风险,公司将通过期货套期保值的避险功能消除或降低价格波动风险。公司开展期货套期保值业务,仅限于本公司生产销售的铝产品的期货交易合约。

二、套期保值的目的

开展铝产品期货交易,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,同时避免铝产品销售价格出现大幅下降可能带来的损失,降低对公司正常经营的影响。

三、投入资金及业务期间

公司在铝产品期货套期保值业务中投入的资金(保证金)全部为自有资金,每年累计在人民币 2 亿元以内的(含追加的临时保证金),由公司董事会授权期货领导小组决定;超过上述标准的,应根据《公司章程》及《公司期货交易管理制度》执行,业务期间为一年。

四、套期保值的风险分析

1、价格波动风险:铝产品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,期货套期保值业务只限于在境内期货交易所交易的铝产品期货,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,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的保证金额度。

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,由总经理提请董事会,董事会决定是否审批新的授权。

本议案内容尚须提交股东大会审议。

六、备查文件

公司第七届董事会第三十七次会议决议

特此公告

河南中孚实业股份有限公司董事会

二〇一五年六月十日