

股票简称: 鲁抗医药

股票代码: 600789

公告编号: 临2013-016

山东鲁抗医药股份有限公司 关于择机开展豆油期货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。

山东鲁抗医药股份有限公司(以下简称“本公司”)七届董事会第八次(临时)会议于2013年7月5日在公司经营大楼804会议室以现场结合通讯方式召开。本次会议召开的通知已于2013年7月2日以通讯形式下发。会议应到董事12人, 实到董事12人, 符合《公司法》和公司《章程》的规定。会议由董事长高祥友先生主持, 经过认真讨论, 审议并全票通过了《关于择机开展豆油期货套期保值业务的议案》。现将相关情况公告如下:

一、开展套期保值业务的必要性

豆油是公司生产所需的主要原料, 整体采购量较大。在期货市场进行套期保值操作, 能合理规避豆油价格波动风险, 控制采购成本。在价格处于低位时, 通过买入期货套期保值, 以期货采购代替现货库存; 在价格处于高位时, 通过卖出套期保值锁定库存风险, 这样, 公司不仅可以将原材料的现货库存数量控制在正常的生产用量内, 而且还能避免不利价格所带来的损失, 可以在一定程度上降低豆油价格波动对公司经营业绩的影响。

二、期货品种

公司套期保值期货品种为与公司生产经营有直接关系的农产品豆油, 在大连商品期货交易所挂牌交易。

三、拟投入资金及业务期间

公司根据实际情况, 预计全年套保数量不超过1.5万吨, 所需保证金合计不超过人民币1500万元。具体操作按公司《商品期货套期保值业务管理制度》的规定执行相关业务流程。

四、套期保值的风险分析

公司进行的商品期货套期保值业务遵循的是锁定原材料价格风险、套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作，因此在签定套期保值合约及平仓时执行严格的风险控制。

存在的风险主要有以下几点：

- 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。
- 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。
- 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。

五、公司采取的风险控制措施

- 1、公司将商品期货套期保值业务与公司生产经营情况相匹配，严格控制期货头寸。
- 2、公司将制定套保方案的设计原则并制定套保方案的具体审批权限。公司套期保值业务仅以规避生产经营中的商品价格风险为目的，不涉及投机和套利交易，同时将严格遵循场内交易的规定，进行套期保值业务的品种仅限于公司生产经营相关的产品，套期保值的数量不能超过实际现货交易的数量，期货持仓量不能超过套期保值的现货量。
- 3、公司应规定期货交易员应严格按照审批确定后的套保方案进行操作，并规定按日编制期货交易报告并提交相关审核或审批人员的制度，确保期货交易风险控制。
- 4、公司以自己名义设立套期保值交易账户，使用自有资金进行套期保值。
- 5、设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展，当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。

六、备查文件

《鲁抗医药七届董事会第八次（临时）会议决议》。

特此公告。

山东鲁抗医药股份有限公司董事会

二〇一三年七月六日