

新希望六和股份有限公司

董事会关于公司 2013 年度证券投资、套期保值业务 及风险控制情况的说明

一、证券投资情况

证券品种	证券代码	证券简称	最初投资成本 (元)	期初持股 数量(股)	期末持股数 量(股)	期末账面值(元)	报告期损益 (元)
基金	无	长信灵活风格 1 号基金	1,000,000.00			1,000,000.00	
基金	无	长信货币基金	20,000,000.00			20,000,000.00	
基金	无	大成货币基金	200,000,000.00			200,000,000.00	
股票	600887	伊利股份	3,970,497.51	103,200	103,200	4,033,056.00	62,558.49
股票	601166	兴业银行	39,418,312.02	3,721,211	3,721,211	37,733,079.54	-1,685,232.48
其他	204001	GC001	5,000,050.00	50,000	50,000	5,000,050.00	
基金	940018	天天发一天期基 金	2,070,265.32			2,077,596.43	7,331.11
合计			271,459,124.85	3,874,411	3,874,411	269,843,781.97	-1,615,342.88

二、衍生品投资情况

单位：万元

衍生品投资 操作方名称	关联关系	是否关 联交易	衍生品投 资类型	衍生品 投资初 始投资 金额	起始日期	终止日期	期末投 资金额	期末投资 金额占公 司报告期 末净资产 比例(%)	报告期实 际损益金 额
山东新希望 六和集团有 限公司	全资子公司	否	期货合约	652.23	2013 年 11 月 21 日	2014 年 08 月 15 日	652.23	0.05%	143.2
合计				652.23	--	--	652.23	0.05%	143.2
衍生品投资资金来源				公司自筹					

三、风险控制说明

公司的证券投资严格按照公司《证券投资管理制度》有关规定进行风险、资金的管控，并在确保公司投资日常运营和资金安全的前提下实施，不会影响公司日常资金正常周转需要和主营业务的正常开展。通过进行适度的证券投资，可提高资金使用效率，能获得一定的投资收益，为公司股

东谋取更多的投资回报。

公司具有较完善的内部控制体系，对证券投资的原则、范围、权限、内部审核流程、资金使用情况的监督、风险控制、责任部门及责任人等均作了详细规定，能有效防范投资风险。

公司以套期保值为目的的衍生品投资，已指定相关部门评估投资风险，分析衍生品投资的可行性与必要性。公司制定有《衍生品投资管理制度》及《期货管理制度》，组织机构健全完善，并配备有相关专业人员，业务流程符合相关规定。

2013 年公司对套期保值品种价值变化能进行有效监控及风险评估，能够按照监管部门相关法规、规定要求，规范进行套期保值业务，遵循了谨慎性原则，内部审批制度及业务操作流程完备，风险控制有效。

新希望六和股份有限公司

董 事 会

二〇一四年四月十六日