

证券代码：601969
债券代码：136667

证券简称：海南矿业
债券简称：16 海矿 01

公告编号：2016-071

海南矿业股份有限公司及子公司 关于开展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。

2016 年 12 月 5 日，海南矿业股份有限公司（以下简称“公司”）第三届董事会第四次会议决议通过《关于公司开展期货套期保值交易的议案》、《关于子公司海南海矿国际贸易有限公司开展期货衍生品交易的议案》、《关于制定〈海南矿业股份有限公司期货套期保值交易管理制度〉的议案》。上述议案需提交股东大会审议。公司开展期货套期保值交易须股东大会批准。

一、期货套期保值业务的概述

为充分利用期货市场的套期保值功能，规避市场风险，充分发挥公司在资本市场平台优势，公司及子公司开展期货套期保值业务，从而提升公司综合竞争能力，改善公司盈利水平。

为了更好地把握市场机会，控制交易风险，公司拟建立完整的期货套期保值业务体系，从而有效防范风险，保障期货套期保值业务稳健开展

期货套期保值交易品种包括铁矿、焦煤、焦炭、螺纹钢、热轧卷板的境内外商品期货交易所或银行制定的标准化合约及金融衍生品。

套期保值交易保证金不超过总额人民币 5000 万元，不得影响公司正常生产经营。

本次公司开展期货套期保值业务不构成关联交易事项，亦不构成重大资产重组事项。

二、期货套期保值业务体系及开展

公司期货套期保值业务体系包括：套期保值交易决策小组、套期保值交易执行小组、套期保值交易结算小组、套期保值交易监督小组。业务体系按照公司建立的《期

货套期保值交易管理制度》的相关规定及流程进行操作，制度内容详见上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）。

三、开展套期保值业务的情况

1、套期保值交易品种

期货套期保值交易品种包括铁矿、焦煤、焦炭、螺纹钢、热轧卷板的境内外商品期货交易所或银行制定的标准化合约及金融衍生品。

2、预计投入资金

套期保值交易保证金不超过总额人民币 5000 万元。

五、套期保值业务风险分析

公司开展商品期货套期保值业务遵循规避产品价格波动、套期保值的原则，不以投机、套利为目的，可能存在价格波动、资金、政策、内部控制、技术等方面的风险，具体如下：

1、价格波动风险

在期货行情变动较大时，可能无法以适当的价格买入期货套期保值合约。

2、资金风险

期货套期保值交易按照《海南矿业股份有限公司期货套期保值交易管理制度》中规定权限下达操作指令，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，在期货价格波动巨大时，公司甚至可能存在未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失的风险。

3、政策风险

期货市场的法律法规政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易带来的风险。

4、内部控制风险

期货套期保值交易专业性较强，执行纪律要求高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。

5、技术风险

可能因为计算机系统不完备导致技术风险。

六、套期保值业务风险控制措施

1、严格控制期货头寸，最大程度对冲产品价格波动风险。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。

3、公司以自身名义设立交易账户，不得使用其他账户操作期货套期保值交易。

4、公司以自有资金进行期货套期保值交易，不得直接或间接使用银行信贷资金及募集资金等不符合法律法规或中国证监会、上海证券交易所禁止的资金进行期货套期保值交易。

6、结合公司实际情况及《期货套期保值交易管理制度》，对套期保值业务组织机构及职责、品种范围、审批权限、风险管理等作出明确规定。公司将严格按照《期货套期保值交易管理制度》规定对各个环节进行控制，公司董事会定期就期货业务的开展进行内控检查。

7、加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，及时合理地调整套期保值思路与方案；组织交易员、风险控制员等相关人员业务培训，提高业务操作能力和应急处置能力；建立符合要求的交易、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。当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。

特此公告。

海南矿业股份有限公司董事会

2016年12月6日