

三力士股份有限公司

关于开展 2017 年度期货套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

为规避天然橡胶价格大幅波动，公司第五届董事会第三十次会议审议通过了《关于开展 2017 年度期货套期保值业务的议案》，同意公司 2017 年度开展不超过 4,000 万元投资额度的天然橡胶套期保值业务。现将有关情况公告如下：

一、套期保值的目的

公司的主营业务为非轮胎橡胶制品的研发、生产与销售，主要产品为橡胶 V 带，生产所用的主要原材料包括橡胶、线绳、棉纱和炭黑等，其中橡胶占主营业务成本近 40%。近期橡胶价格持续处于低位水平，公司决定通过开展套期保值稳定公司原材料价格的成本，降低原材料价格波动对公司经营业绩的影响。

二、交易品种和规模

公司本次套期保值的交易品种为天然橡胶，总规模不超过 4,000 万元。

三、业务开展的期限

业务期间为 2016 年度股东大会召开之日起至 2017 年度董事会召开之日。

四、套期保值的风险分析

（一）期货价格波动风险

期货价格波动风险指公司购入橡胶套期保值仓位后，由于突发不利因素造成期货价格在短期内出现大幅下跌，造成公司被迫平仓产生较大损失或公司无法通过交割现货实现盈利。

（二）操作不当风险

操作不当风险是指公司内部控制制度不严密或操作未严格按内部控制制度执行，造成橡胶套期保值业务出现亏损。

五、公司采取的风险控制措施

（一）期货价格波动风险应对措施

根据公司的橡胶实际用量以及发展新业务需要，规定了套期保值持仓总手数不超过 400 手，即 4,000 吨。同时，公司也将在购入橡胶期货的价格上严格控制，确保买入的橡胶期货价格低于公司产品对应的橡胶合理采购价格。

（二）操作不当风险应对措施

公司制定并完善了《境内期货套期保值内部控制制度》，对公司期货套期保值业务的组织机构、授权制度、业务流程、风险管理制度、报告制度、档案管理制度、保密制度、合规检查制度等内容进行了详细的规定。同时董事会授权总经理建立了公司期货领导小组，并设置了套期保值业务组织架构，包括交易员、结算员、风险管理员、资金调拨员、交易确认员、会计核算员、档案管理员等，对公司期货业务流程亦做出了详细的规定。

在风险控制方面，公司设置了风险管理员岗位，制定了风险管理员主要职责；在已经确认对实物合同进行套期保值的情况下，期货头寸的建立、平仓要与所保值的实物合同在数量上及时间上相匹配；同时公司建立了风险测算系统，对资金风险和保值头寸价格变动风险也作出了严格要求；公司为应对当市场价格波动较大或发生异常波动的情况，还建立了内部风险报告制度和风险处理程序，以及及时采取应对措施。

六、备查文件

1、公司第五届董事会第三十次会议决议。

特此公告。

三力士股份有限公司董事会

二〇一七年三月十七日