

股票简称：广州发展
公司债券简称：12广控01
企业债券简称：G17发展1

股票代码：600098
公司债券代码：122157
企业债券代码：127616

临 2018-014 号

广州发展集团股份有限公司 关于控股子公司广州珠江电力燃料有限 公司开展动力煤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。

广州发展集团股份有限公司（以下简称“广州发展、公司、本公司”）于2018年4月12日以通讯表决方式召开第七届董事会第二十六次会议，审议通过了《关于公司控股子公司广州珠江电力燃料有限公司开展动力煤期货套期保值业务的议案》，现就相关事宜公告如下：

一、开展动力煤期货套期保值业务的必要性

为平抑煤价波动风险，提升公司竞争能力，降低属下电厂燃料成本，创新采购模式，公司属下控股子公司广州珠江电力燃料有限公司（简称“燃料公司”）拟开展动力煤套期保值业务，不进行任何投机和套利交易。

二、拟开展动力煤期货套期保值业务概述

交易品种：仅限郑州商品交易所的动力煤期货。

交易流程和制度：严格按燃料公司《动力煤套期保值管

理制度》执行，并根据业务实际情况不断修订和完善。广州发展电力集团有限公司（简称“电力集团”）委托燃料公司进行动力煤期货套期保值业务，并按照《广州发展电力集团有限公司动力煤期货套期保值业务管理办法》开展业务。

市场煤的持仓规模：动力煤期货卖出套保量不得超过燃料公司库存规模的 75%；买入套保不超过月度动力煤采购计划量 30%。公司各属下电厂全年最大套保量原则上不超过企业全年电煤耗量的 20%，持仓规模应当与现货及资金实力相适应，不得超过同期保值范围现货的 90%。

三、风险控制措施

为进一步规范动力煤期货套期保值业务，有效防范和化解风险，根据《上海证券交易所上市公司内控指引》的有关要求，燃料公司、电力集团分别制定了《广州珠江电力燃料有限公司动力煤套期保值管理制度》、《广州发展电力集团有限公司动力煤期货套期保值业务管理办法》，明确了交易原则、组织机构及分工、交易流程、风险控制、廉洁从业条款等相关内容。

四、对公司的影响

在严格做好风险控制的原则下，开展动力煤套期保值业务，将有助于增强燃料公司应对煤炭价格波动的风险，适当降低属下电厂燃料成本，提升公司生产经营能力。

特此公告。

广州发展集团股份有限公司

董 事 会

二〇一八年四月十三日