

浙江菲达环保科技股份有限公司 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。

浙江菲达环保科技股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）于 2018 年 8 月 16 日召开第七届第三次会议，审议通过了《关于开展热卷期货套期保值业务的议案》。该议案无需提交公司股东大会审议，相关情况公告如下：

一、套期保值业务基本情况

（一）套期保值的目的和必要性

鉴于标准品热轧卷板约占公司产品成本的 15%，采购量约 1000 吨/月，采购成本受市场价波动影响较大，为合理规避热轧卷板价格波动风险，稳定原材料价格，锁定经营利润，确保公司生产经营的正常、稳定运行，公司决定开展热轧卷板套期保值业务。

（二）开展套期保值业务情况

交易品种仅限于在上海期货交易所挂牌的热轧卷板期货，买入量累计不超过 1 万吨/年，总投资不超过 1,000 万元，期限：自董事会审议通过之日起一年。

二、套期保值风险分析

（一）市场风险

一是市场发生系统性风险；二是价格预测发生方向性错误；三是期货价格与现货价格走势背离等带来风险。

（二）政策风险

有关期货市场的法律法规等监管规定如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来的风险。

（三）流动性风险

期货交易中，受市场流动性不足的限制，可能会使公司不能以有利的价格进出期货市场。

（四）操作风险

期货交易专业性较强，可能存在操作不当或操作失败带来的风险。

（五）技术风险

由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应风险。

三、公司拟采取的风险控制措施

（一）严格执行有关法律法规及公司《套期保值业务管理制度》相关规定，并在董事会审议通过的审批权限内办理公司期货套期保值业务。

（二）遵循锁定原材料价格风险、套期保值原则，不做投机性、套利性期货交易操作。

（三）合理设置公司期货业务组织机构，建立岗位责任制，明确各相关部门和岗位的职责权限。

（四）建立公司的期货业务的授权制度、审批制度及业务流程；严格按照规定程序进行保证金及清算资金的收支；建立持仓预警报告和交易止损机制，防止交易过程中由于资金收支核算和套期保值盈亏计算错误而导致财务报告信息的不真实；防止因重大差错、舞弊、欺诈而导致损失；确保交易指令的准确、及时、有序记录和传递。

（五）合理计划和安排使用保证金，保证套期保值过程正常进行。与此同时，合理选择保值月份，避免市场流动性风险。

特此公告。

浙江菲达环保科技股份有限公司

董 事 会

2018年8月20日