

中粮生物化学（安徽）股份有限公司

关于开展2019年度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。

中粮生物化学（安徽）股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 1 月 11 日召开七届董事会 2019 年第一次临时会议，审议通过了《关于开展 2019 年度期货套期保值业务的议案》，本事项无需提交公司股东大会审议，具体情况公告如下：

一、开展期货套期保值业务的目的和意义

为充分发挥期货套期保值功能，有效控制市场风险，降低原料、产品、原油等市场价格波动对公司生产经营成本及主营产品价格的影响，公司计划开展相关商品期货套期保值交易，充分利用期货市场的套期保值功能，提升公司整体生产经营管理水平、抵御风险能力。

二、开展期货套期保值业务概述

公司套期保值期货品种为与公司生产经营有直接关系的原料、产品、原油等期货品种，主要包括：玉米、淀粉、白糖、豆油、豆粕和布伦特原油等品种。

公司委托中粮期货有限公司（以下简称“中粮期货”）、国投安信期货有限公司、深圳中粮商贸服务有限公司（以下简称“深圳中粮商贸”）为代理方开展期货交易。

双方签订《期货套保服务协议》。依据服务协议条款规定代理方将收取相应的服务费，根据《深圳证券交易所股票上市规则》的规定，公司和中粮期货、深圳中粮商贸同为中粮集团间接控股公司，上述交易构成关联交易。

2019 年，公司根据实际情况，预计资金使用额度最高不超过人民币 5,000 万元（即任一时点不超过 5,000 万元）。如拟投入资金有必要最高额超过人民币 5,000 万元的，将按公司《商品期货套期保值业务管理制度》的规定执行额度追

加审批并予以公告。

三、期货套期保值业务的风险分析

公司进行期货套期保值业务不以投机、套利为目的，主要为有效规避原料、产品、原油价格波动对公司带来的影响，但同时也会存在一定的风险：

1、价格波动风险：原料、产品、原油价格行情变动较大时，可能产生价格波动风险，造成交易损失。

2、资金风险：套期保值交易按照公司相关制度中规定的权限下达操作指令，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。

3、内部控制风险：套期保值交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成的风险；

4、交易对手违约风险：在套期保值周期内，可能会由于原料、产品、原油价格周期波动，场外交易对手出现违约而带来损失；

5、技术风险：由于无法控制或不可预测的系统、网络、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。

6、政策风险：如果衍生品市场以及套期保值交易业务主体所在国家或地区的法律法规政策发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易带来的风险。

7、汇率风险：目前原油衍生品市场仍主要采用美元进行结算，套期保值业务的损益影响公司以人民币计价的会计收入，但由于公司套期保值业务的目的是为了对冲公司以美元计价的原油销售价格波动风险，所以整体上没有新增公司面临的汇率风险。

四、期货套期保值业务的风险控制措施

为了应对套期保值业务的上述风险，公司从如下途径进行风险控制：

1、将套期保值业务与公司生产经营相匹配，严格控制期货头寸，持续对套期保值的规模、期限进行优化组合，确保公司的利益。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，严格按照公司套期保值管理制度规定下达操作指令，根据审批权限进行对应的操作。公司将合理调度资金用于套期保值业务。

3、公司制定了《套期保值管理制度》作为套期保值内控管理制度，并结合

公司实际指导具体业务操作，同时加强相关人员的专业知识培训，提高套期保值从业人员的专业素养。

4、在业务操作过程中，严格遵守有关法律法规的规定，防范法律风险，定期对套期保值业务的规范性、内控机制的有效性等方面进行监督检查。

五、期货公允价值分析

公司衍生品交易所选择的交易所和交易品种市场透明度大，成交活跃，流动性较强，成交价格和结算价能充分反映衍生品的公允价值。

六、会计政策及核算原则

公司根据《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 24 号-套期保值》对金融衍生品的公允价值予以确定。

七、独立董事意见

根据《上市公司治理准则》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《深交所主板上市公司规范运作指引》的相关规定，公司独立董事对公司以套期保值为目的的衍生品投资及风险控制情况发表如下意见：

公司开展套期保值业务，履行了相关审批程序，符合国家相关法律法规的规定；公司通过加强内部控制，成立套保工作决策和管理机构，制定风险控制制度，落实风险防范措施；制定的套期保值计划和外汇风险敞口符合公司生产经营实际，组织机构健全、完善，业务流程符合相关规定，不存在损害公司和全体股东利益情况。以上衍生品的业务有利于发挥公司竞争优势，公司开展衍生品业务方案是可行的，风险是可控的。

所采取的程序符合相关法律、法规及《公司章程》的规定。

八、备查文件

公司七届董事会 2019 年第一次临时会议决议。

特此公告

中粮生物化学（安徽）股份有限公司

董事会

2019 年 1 月 11 日