

盈峰环境科技集团股份有限公司

关于2019年度期货套期保值业务年度规划的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

盈峰环境科技集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2019年4月17日召开第八届董事会第二十七次会议，审议通过了《关于2019年度期货套期保值业务年度规划的议案》。现将有关套期保值业务情况公告如下：

一、履行合法表决程序的说明

经公司第八届董事会第二十七次会议审议通过本次拟开展大宗材料期货套期保值业务。公司的衍生品投资仅限于以套期保值为目的的衍生品投资，董事会可自行决定以套期保值为目的的衍生品投资种类和金额，董事会授权总经理在职权范围内进行套期保值程序审批，有效期限为董事会审议通过后12个月内。。

本次拟开展的大宗材料期货套期保值业务不购成关联交易。

二、开展套期保值业务的必要性

电解铜是公司电磁线产品的主要原材料之一，因生产经营需要，公司保有一定的库存，包括铜杆、半成品、产成品；公司也适应客户需要，与客户达成远期交易合同。

受宏观经济波动、流动性变化等影响，电解铜的价格波动比较大；公司为了规避铜价波动对库存、远期交易合同造成的风险，根据自有库存量、远期交易合同价格及交货时间等，开展套期保值业务，以规避铜价波动风险。

三、套期保值业务概述

1、交易品种

上海交易所阴极铜标准合约。

2、交易量

自有库存套保，根据自有库存数量调整开仓头寸数量。预计2019年公司铜电磁线销量54,000吨，预计月度平均自有库存数量1,300吨左右，按制度套期保值头寸范围为80%-125%，预计开仓数量控制在1,000吨-2,400吨。

客户远期交易合同，根据交货时间、结算价格、数量确定开仓头寸。

四、管理制度

《期货套期保值业务管理制度》。

五、套期保值风险分析

1、铜价波动，会使期货合约出现损失。当自有库存公允价值变动会全部或部分抵消期货合约损失；

2、客户违约风险。铜价波动，客户取消远期合同或不能按期履行合同，会给公司造成损失；

3、期货操作风险。如果铜价大幅度波动，未及时补充期货保证金，有被强行平仓风险；日常操作中，误操作导致反向开仓，若未及时发现，将有可能给公司造成损失。

六、套期保值风险控制措施

1、严格根据自有库存、客户远期合同，确定期货合约开仓数量；

2、公司将严格按照内控制度合理分配期货操作各环节工作，进行严格的授权、复核；

3、公司内部部门相互稽核，每日跟踪铜价波动、开仓头寸、自有库存数量，及时对风险采取应对措施。

七、公允价值分析

公司套期保值交易品种为上海期货交易所上市的阴极铜，市场透明度大，成交活跃，成交价格充分反映衍生品的公允价值。

八、会计政策及核算原则

公司根据财政部《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——套期会计》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》相关规定及其指南，对已开展的衍生品业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目。

九、 独立董事意见

公司独立董事发表了独立意见：（1）公司在保证正常生产经营的前提下，使用自有资金开展期货套期保值业务履行了相关的审批程序，符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，有利于公司降低经营风险，不存在损害公司和全体股东利益的情况。

（2）公司建立了《期货套期保值业务管理制度》，明确了业务操作流程、审批流程及风险防控等内部控制程序，对公司控制期货风险起到了保障的作用。

（3）公司确定的年度套期保值保证金的最高额度和交易品种合理，符合公司的实际生产经营情况，有利于公司合理的控制交易风险。

十、 备查文件

1. 公司第八届董事会第二十七次会议决议；
2. 公司第八届监事会第二十四次会议决议；
2. 独立董事意见。

特此公告。

盈峰环境科技集团股份有限公司

董 事 会

2019年4月19日