

深圳王子新材料股份有限公司

关于子公司开展商品期货套期保值业务的公告

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

深圳王子新材料股份有限公司（以下简称“公司”）于2019年6月6日召开第四届董事会第五次会议，审议通过了《关于子公司开展商品期货套期保值业务的议案》，同意公司控股子公司北京金叶高登科技有限公司（含其下属公司，以下简称“北京金叶”）在期货账户保证金余额不超过人民币150万元额度内开展聚乙烯期货套期保值业务，具体内容如下：

一、商品期货套期保值业务开展的目的

北京金叶主要产品为塑料薄膜等包装产品，产品主要原材料为聚乙烯，约占生产成本69.72%，且单位价值较高，为规避原材料市场价格波动给公司主营业务带来的经营风险，北京金叶拟开展聚乙烯套期保值业务。

二、商品期货套期保值基本情况

1、套期保值期货品种范围：只限于在境内期货交易所上市的聚乙烯期货合约。

2、保证金额度：投入的保证金最高余额不超过人民币150万元，资金额度可滚动使用。

3、投资期限：自本次董事会批准之日起12个月。

三、商品期货套期保值业务的可行性分析

经对北京金叶所处行业、结合公司自身经营状况以及国内国外的经济形势分析，参考国内相关大型塑料行业经营企业的经验和惯例，北京金叶在相关批准范围内开展期货的套期保值业务可以有效地规避聚乙烯等原材料的价格波动风险，锁定生产经营成本，稳定产品利润水平，提升持续盈利能力和综合竞争能力。

公司已建立了较为完善的商品期货套期保值制度，具有与拟开展套期保值业务交易相匹配的自有资金，公司将严格按照《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》和公司《商品期货套期保值管理制度》的相关规定，落实内部

控制和风险管理措施，审慎操作。综上所述，公司开展期货套期保值业务具备可行性，有利于公司在一定程度上规避经营风险。

四、商品期货套期保值业务风险分析

套期保值业务是为了锁定原材料价格波动的风险，不做投机和套利交易，期货套期保值的数量原则上不得超过实际生产需采购的数量，期货持有量应不超过需要保值的数量，但期货市场仍会存在一定风险：

1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成投资损失。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金风险。

3、流动性风险：可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

4、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成风险。

5、会计风险：北京金叶期货交易持仓的公允价值随市场价格波动可能给公司财务报表带来的影响，进而影响财务绩效。

6、技术风险：从交易到资金设置、风险控制，到与期货公司的联络，内部系统的稳定与期货交易的匹配等，存在着因系统崩溃、程序错误、信息风险、通信失效等可能导致交易无法成交的风险。

五、拟采取风险控制措施

1、将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，使用自有资金用于套期保值业务，不使用募集资金直接或间接进行套期保值，同时加强资金管理的内部控制，不得超过公司董事会批准的保证金额度。

3、将重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

4、根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所中小企业板规范运作指引》等相关规定，结合公司实际情况，制订《商品期货套期保值管理制度》，对套期保值额度、品种范围、内部流程、风险管理等作出了明确的规定，公司将严格按照《商品期货套期保值管理制度》规定对各个环节进行控制，同时加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

5、公司将严格按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则第 22 号—

金融工具确认和计量》及《企业会计准则第 24 号一套期保值》相关规定执行，合理进行会计处理工作。

6、设立符合要求的计算机系统及相关设施，选配多条通道，降低技术风险。

六、对公司的影响

按照决策、执行、监督职能相分离的原则，公司商品期货套期保值交易将建立严格的审批和执行程序；公司控股子公司北京金叶进行商品期货套期保值操作，有利于规避原材料市场价格波动带来的经营风险，有利于保持北京金叶产品成本的相对稳定，降低聚乙烯等原材料价格波动对公司的影响。

七、其他事项

公司为进行套期保值而指定的商品期货的公允价值变动与被套期项目的公允价值变动相抵销后，导致亏损金额每达到或超过公司最近一年经审计的归属于上市公司股东净利润绝对值的 10%且亏损金额超过 1,000 万元人民币时，本公司将在两个交易日内及时披露。

八、独立董事意见

北京金叶开展聚乙烯期货套期保值业务，是为了降低价格波动影响，更好地规避原材料价格波动给公司经营带来的风险，减少价格波动对公司经营业绩造成的影响。公司已制订了《商品期货套期保值管理制度》，且具有与拟开展套期保值业务交易保证金相匹配的自有资金。我们同意北京金叶开展期货套期保值业务，投入的保证金最高余额不超过人民币 150 万元，资金额度可滚动使用。

九、监事会意见

监事会认为：公司控股子公司北京金叶开展聚乙烯期货套期保值业务，能够降低价格波动对公司经营业绩造成的影响，不会损害上市公司和股东的利益。同意北京金叶开展期货套期保值业务，投入的保证金最高余额不超过人民币 150 万元，资金额度可滚动使用。

十、备查文件

公司第四届董事会第五次会议决议。

特此公告。

深圳王子新材料股份有限公司董事会

2019 年 6 月 6 日