

股票代码：000039、299901 股票简称：中集集团、中集 H 代 公告编号：【CIMC】2019-074

中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司

关于 2019 年度开展钢材期货套期保值交易的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

为了降低原材料现货价格波动对公司业务经营的影响，经中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”，与其子公司合称“本集团”）第九届董事会 2019 年度五次会议审议通过了《关于 2019 年度集团钢材期货套期保值交易管理的议案》，同意本公司及其子公司于 2019 年度开展钢材期货套期保值业务。现将有关情况公告如下：

一、开展钢材期货套期保值业务的目的

本集团开展钢材期货套期保值业务，目的在于通过国内期货市场工具套期保值，平滑原材料现货价格波动对公司经营的影响，将影响降低至可控或可承受范围，稳定和改善经营，确保公司长期经营目标和战略目标的实现。

二、2019 年度钢材期货套期保值业务的基本情况

本集团 2019 年度将开展的钢材期货套期保值业务基本情况如下：

业务种类	本集团开展钢材期货套期保值业务，合约品种限于国内期货交易所上市、与公司生产经营活动相关的钢材期货品种，包括热轧卷板期货合约等。
保值规模	2019 年本公司及其子公司钢材期货交易占用保证金余额不超过人民币 2000 万元，额度可滚动使用。
合约期限	钢材期货套期保值业务的合约期限与经营周期相匹配，原则上不超过 6 个月。
钢材期货套期保值业务合约对手方	期货公司。
资金来源	本公司及其子公司将利用自有资金进行钢材期货套期保值业务。
董事会授权期限	自 2019 年本公司董事会决议签署之日起，至 2020 年新的相关董事会决议签署之日止。

三、钢材期货套期保值业务的风险分析

1、市场风险：当期货行情大幅波动时，公司可能无法在预定的价格进行套期保值交易开仓或平仓操作，造成额外套期保值损失。

2、流动性风险：期货保证金交易可能造成公司资金流动性风险，在期货价格波动巨大时，公司甚至可能存在未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失的风险。

3、政策风险：国家政策及期货市场的法律法规政策变化，对市场造成的影响。如国家钢铁产业政策的重大变化、期货交易所调整钢材期货交易保证金比例等，可能引起市场波动或无法交易带来的风险。

4、操作风险：因公司团队成员操作不当而造成的风险。包括交易过程中出现的指令下达失误等。

5、技术风险：由于无法控制或不可预测的系统、网络、通讯故障等原因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，从而带来的相应风险。

四、本集团对钢材期货套期保值的风险管理措施

1、严格遵守国家法律法规，建立《钢材期货套期保值管理制度》，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；制定期货账户资金管理和风控原则，对业务信息传递、交易审批权限、内部审核流程等做出明确规定。

2、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，最大程度对冲原材料价格波动风险。期货头寸的建立、平仓与所保值的实物合同在数量上及时间上相匹配。

3、公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。

4、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，确保交易指令的准确、及时、有序记录和传递。

5、建立风险测算系统，设立关键业务监控指标。

6、设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。

五、钢材期货套期保值的会计核算方法

本公司及其子公司钢材期货套期保值交易的相关会计政策及核算原则按照财政部发布的《企业会计准则—金融工具确认和计量》及《企业会计准则—套期保值》相关规定执行。

六、董事会审议情况

2019年8月27日，本公司第九届董事会2019年度第五次会议审议并全票通过了《关于2019年度集团钢材期货套期保值交易管理的议案》：同意本公司及控股子公司采用国内期货交易所钢材期货合约（热轧卷板期货合约等）进行套期保值交易，保值工具清晰明确。保值期限与经营周期相匹配，原则上不超过6个月。原则上套期保值交易总量不超过实际现货交易总量，当期待结算钢材期货净敞口不高于当期将结算现货净敞口。钢材期货交易保证金持仓总额不超过人民币2000万元。

七、独立董事意见

经对公司2019年度开展钢材期货套期保值业务进行核查，本公司独立非执行董事发表独立意见如下：公司开展2019年度钢材期货交易的目的在于通过期货市场工具实现套期保值，平滑材料价格波动对公司经营造成的波动，降低价格变化对公司经营的影响至可控或可承受范围，稳定和改善经营，确保公司长期经营目标和战略目标的实现。公司开展2019年度钢材期货交易的审批程序符合有关法律法规、《公司章程》以及公司相关制度等的规定，不存在损害公司及公司股东特别是中小股东利益的情形。

八、备查文件

- 1、本公司第九届董事会2019年度第五次会议决议。
- 2、本公司第九届董事会独立董事的相关独立意见。

特此公告。

中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司

董事会

二〇一九年八月二十七日