

证券代码：600346

证券简称：恒力石化

公告编号：2021-027

债券代码：155749

债券简称：19恒力01

恒力石化股份有限公司

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。

恒力石化股份有限公司（以下简称“公司”）于2021年4月12日召开第八届董事会第十七次会议，审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，公司下属公司拟开展期货套期保值业务，具体情况如下：

一、开展期货交易的目的

公司下属公司主要经营原油加工及石油制品生产与销售、PTA、化工品（包括但不限于苯乙烯、乙二醇、聚丙烯）生产与销售业务，其价格受国际和国内价格的影响较大，为规避原油和产品价格的大幅波动给公司经营带来的不利影响，拟开展套期保值业务，充分利用期货市场功能，有效管理价格大幅波动的风险，提升企业经营水平，保障企业健康持续运行。

二、开展期货套期保值业务情况

根据生产经营计划，本着谨慎原则，2021年预计开展期货套期保值所需保证金不超过人民币33亿元（其他币种按当期汇率折算成人民币汇总），采用滚动建仓的方式，额度可以循环使用。期限自董事会审议通过之日起12个月。开展期货套期保值业务，需要使用一定比例的银行授信额度或自有资金作为保证金，缴纳保证金不会对公司的资金使用计划造成不利影响。

三、风险分析及风险控制措施

（一）风险分析

公司下属公司开展期货交易业务不以投机为目的，主要为规避原油和产品价格的大幅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：期货行情变动较大，可能产生价格变化方向与公司预测判断相背离的情况，造成期货交易的损失。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能会带来相应的资金风险。

3、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。

4、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。

（二）风险控制措施

1、公司制定了期货套期保值业务的相关管理制度，明确了开展套期保值业务的组织机构及职责、审批授权、业务流程、风险管理等内容，通过严格的内部控制指导和规范执行，形成较为完整的风险控制体系。

2、将套期保值业务与下属公司生产、经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。

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、公司内控审计部定期或不定期对套期保值业务进行检查，监督套期保值工作的开展，控制风险。

5、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。当发生错单时，及时采取相应处理措施，并减少损失。

四、独立董事意见

独立董事认为：公司已建立健全相关内控制度，通过加强内部管理，落实风险防范措施，控制投资风险。开展商品期货套期保值业务符合实际经营的需要，一定程度上规避原油和产品价格的大幅波动给公司经营带来的不利影响，降低生产运营风险，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。相关审议程序符合相关法律法规、规范性文件的规定。因此，我们同意此事项。

特此公告。

恒力石化股份有限公司董事会

2021年4月13日