

## 东莞市华立实业股份有限公司

### 关于调整公司 2017 年度期货交易授权额度的公告

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。

东莞市华立实业股份有限公司（以下简称“公司”）于 2017 年 4 月 19 日召开第四届董事会第四次会议，审议并通过了《关于公司 2017 年度期货交易额度授权的议案》，同意公司 2017 年度开展 PVC 品种期货套期保值交易的累计开仓金额不超过人民币 10,000 万元（即不超过公司 2017 年度主要原材料 PVC 粉预计采购金额的 60%），并同意授权董事长在该额度范围内对套期保值交易方案进行决策并签署相关合同文件。详见公司 2017 年 4 月 21 日于上海证券交易所网站（[www.sse.com.cn](http://www.sse.com.cn)）及公司指定信息披露媒体刊登的相关公告。截至本公告披露日的前一交易日，公司 2017 年期货合约累计开仓总额为人民币 8,818.65 万元。

2017 年 6 月底以来，国内 PVC 期货市场行情持续走强，PVC 粉现货价格也呈现持续上涨的态势，进而导致公司主要原材料采购成本不断上升。为了降低 PVC 价格持续上涨对公司主要原材料采购成本的冲击影响，公司于 2017 年 9 月 8 日召开第四届董事会第八次会议，审议通过了《关于调整公司 2017 年度期货交易授权额度的议案》，同意公司在第四届董事会第四次会议审议的 2017 年度开展 PVC 期货套期保值交易的累计开仓金额不超过人民币 10,000 万元的基础上增加 3,500 万元，至累计开仓总额不超过人民币 13,500 万元（即不超过公司 2017 年度主要原材料 PVC 粉预计采购金额的 80%），并同意授权董事长在该额度范围内对套期保值交易方案进行决策并签署相关合同文件。本次调整公司 2017 年度期货交易授权额度的事项无须提交股东大会审议。

#### 一、概况

### 1、期货套期保值交易目的

公司主要原材料 PVC 粉市场价格受国内供给侧改革及国际油价波动的影响较大，为部分对冲原材料采购价格大幅度上涨的风险，公司有必要对主要原材料采购活动进行期货套期保值交易，从而防范因主要原材料采购价格持续上涨导致的经营风险。

### 2、投资期限

公司从事套期保值交易的期货品种为主要原材料相匹配的 PVC 期货，期货合约持仓投资时间一般应与公司经营计价期相匹配。

### 3、额度限制

公司 2017 年度期货套期保值交易的累计开仓金额不超过 2017 年度主要原材料 PVC 粉预计采购金额的 80%（即不超过人民币 13,500 万元）。

## 二、实施方式

公司组织建立期货交易管理小组行使套期保值投资计划、方案审批、风险处置等管理工作，公司采购部行使期货套期保值交易方案呈报、执行、交易结果及相关风险汇报等工作，公司财务部负责期货交易保证金的支付、根据套期保值交易对账单进行会计处理。

## 三、风险分析及风险控制措施

公司进行期货套期保值业务主要为部分对冲原材料采购价格大幅度上涨的风险，但同时也会存在一定的风险：

1、市场风险。期货市场自身存在着一定的系统性风险，同时套期保值需要对价格走势作出一定的预判，一旦价格预测发生方向性错误有可能会给公司造成损失。

2、政策风险。期货市场的法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来的风险。

3、流动性风险。在期货交易中受市场流动性不足的限制，可能会使公司不能以有利的价格进出期货市场。

4、操作风险。期货交易专业性较强，存在操作不当或操作失败，从而带来

相应风险。

5、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。

公司针对以上风险，严格按照公司相关制度规定进行事前、事中及事后的风险控制和管理，有效防范、发现和化解风险，确保进行套期保值交易的资金相对安全。公司主要采取措施如下：

1、在期货交易内部控制制履行决策程序上，公司按照公司期货交易相关管理制度的规定来安排计划、审批、指令下达、操作、稽查、审计等环节并进行相应的管理。

2、公司成立期货套期保值管理小组，由董事长及负责相关业务的公司高管担任小组成员，负责公司期货交易决策及日常管理。期货交易决策小组会任命专职的管理员，负责日常的期货交易实时监控及风险评估。公司安排专业人员密切关注市场波动情况，针对可能存在的各项风险及时评估分析及汇报，由期货交易决策小组做出包括止损限额在内的所有风险管理决策。

#### **四、独立董事意见**

独立董事认为：公司根据自身经营特点及原材料价格波动特性，在遵循业务匹配性、合规性前提下对主要原材料进行套期保值操作，不会影响公司主营业务的正常发展。同时，公司具有主要原材料期货套期保值操作经验和比较规范的套期保值管理制度，与年度经营计划相匹配的套期保值操作按照《公司章程》及套期保值管理制度履行了恰当的审批程序，符合公司和全体股东的利益，不存在损害公司和中小股东权益的情形。因此，公司独立董事同意公司 2017 年度在不超过人民币 13,500 万元的范围内开展与主要原材料相关的套期保值操作。

#### **五、对公司经营的影响**

公司按照决策、执行、监督职能相分离的原则建立健全相关投资的审批和执行程序，确保投资事宜的有效开展和规范运行，确保资金安全。在符合国家法律法规，并确保不影响公司主营业务正常开展的前提下，公司进行与年度经营计划

相匹配的套期保值操作，不会影响公司业务的正常开展。同时，公司通过与主要原材料相匹配期货品种的套期保值交易锁定了原材料采购成本，锁定公司未来需要交货的生产成本和利润，从而，有利于公司稳定发展与股东的稳定回报。

## 六、备查文件

- 1、《东莞市华立实业股份有限公司第四届董事会第八次会议决议》；
- 2、《东莞市华立实业股份有限公司独立董事关于第四届董事会第八次会议相关事项的独立意见》。

特此公告。

东莞市华立实业股份有限公司董事会

2017年9月9日