

上海宝钢包装股份有限公司 关于开展商品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。

上海宝钢包装股份有限公司（以下简称“宝钢包装”或“公司”）第五届董事会第十七次会议审议通过了《关于开展商品期货套期保值业务的议案》，具体情况如下：

一、套期保值的目的和必要性

铝材是公司生产经营的主要原料之一。为了减少因铝材现货市场价格波动，对公司生产经营带来影响和风险，公司计划开展铝商品期货交易，是充分利用期货市场的套期保值功能，减少因原材料价格波动造成的生产成本波动，进而提升公司生产经营水平和抗风险能力。

二、套期保值业务的交易额度和期限

1、公司 2019 年度预计套期保值交易计划为：铝材年度交易量不超过 6 万吨，保证金额度不超过 9,000 万元人民币。

2、套期保值业务授权期限

授权期限自本次董事会审议通过且获得上级主管部门批复之日起至 2019 年 12 月 31 日止，上述额度在期限内可循环滚动使用，并授权公司管理层在此授权范围内根据公司业务情况、实际需要择机开展套期保值业务。

三、公司采取的风险控制措施

1、严格执行有关法律法规及公司《铝锭套期保值业务管理制度》相关规定，并在董事会审议通过的审批权限内办理公司期货套期保值业务。

2、根据公司生产经营需求严格进行套期保值操作，期货头寸必须有相对应的现货敞口保值需求，禁止进行期货投机交易。

3、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。

4、建立公司的期货业务的授权审批制度及业务流程；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，防止交易过程中由于资金收支核算和套期保值盈亏计算错误而导致财务报告信息的不真实；防止因重大差错、舞弊、欺诈而导致损失；确保交易指令的准确、及时、有序记录和传递。

5、合理计划和安排使用保证金，保证套期保值过程正常进行。与此同时，合理选择保值时点，避免市场流动性风险。

6、在业务操作过程中，严格遵守国家有关法律法规的规定，防范法律风险，定期对期货套期保值业务的规范性、内控机制的有效性等方面进行监督检查。

四、备查文件

1、公司第五届董事会第十七次会议决议

特此公告。

上海宝钢包装股份有限公司

董事会

二〇一八年十二月二十六日