

诺力智能装备股份有限公司 关于 2019 年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。

2019年3月25日,诺力智能装备股份有限公司(以下简称“公司”或“诺力股份”)第六届董事会第十七次会议审议通过《诺力智能装备股份有限公司关于2019年开展套期保值业务的议案》,具体内容如下:

一、套期保值业务基本情况

(一)套期保值的目的和必要性

鉴于钢材等原材料占公司产品成本比重较大,采购价格受市场价波动影响较大,为合理规避以上主要原材料价格波动风险,稳定原材料价格,锁定经营利润,确保公司生产经营的正常、稳定运行,公司决定充分利用期货市场的套期保值功能,开展期货套期保值业务,期限自董事会审议通过之日起一年。公司套期保值业务使用自有资金进行操作,仅用于规避主要原材料价格波动等风险,不作为盈利工具使用。

(二)开展套期保值业务情况

公司期货套期保值业务仅限于公司生产经营相关的产品或所需的原材料:主要原材料热轧卷板对应的期货品种热轧卷板套期保值业务,套期保值规模为5,000吨,全年套期保值投资额度控制在人民币2,000万元以内。

二、套期保值风险分析

(一)市场风险:主要表现为基差风险和保值率风险。基差风险指期货市场在一段时期内现货价格与期货价格的差值的变动风险,它直接影响套期保值效果;保值率风险指公司持有的现货资产往往难以与期货对应标的的现货组合完全吻合而产生的风险。

(二)流动性风险:套期保值策略的实施存在流动性风险,如果内部执行成本很高或者期货市场流动性差,套期保值策略难以执行,将形成敞口暴露在市场风险之下。

(三) 操作风险：期货交易专业性较强，套期保值的顺利进行需要业务人员专注的从业精神，而其可靠性、准确性十分关键，但难免产生一定风险。

(四) 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。

三、公司拟采取的风险控制措施

(一) 严格执行有关法律法规及公司《期货套期保值内部控制制度》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。

(二) 遵循锁定原材料价格风险、套期保值原则，不做投机性、套利性期货交易操作。

(三) 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。

(四) 建立公司的期货业务的授权制度、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。

(五) 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，合理选择保值月份，避免市场流动性风险。

特此公告。

诺力智能装备股份有限公司董事会

2019年3月25日