

## **匹凸匹金融信息服务（上海）股份有限公司**

### **关于开展期货套保业务的公告**

本公司董事会及全体董事保证本公告不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，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。

匹凸匹金融信息服务（上海）股份有限公司（以下简称“公司”）第七届董事会第三十一次会议审议通过了《关于期货套保业务计划的议案》，同意在本议案通过董事会审议之后1年内，全资子公司上海事聚贸易有限公司投入保证金不超过3000万元，开展期货套期保值业务，现将相关情况公告如下：

#### **一、目的和必要性**

金属材料、农产品等大宗商品的供应链管理与服务是上海事聚贸易有限公司的主要业务模式之一，为规避宏观经济系统性风险及大宗原材料商品价格波动对经营产生的不利影响，管理价格风险，公司有必要以风险管理为出发点，开展期货套保业务。

#### **二、业务模式和操作主体**

公司期货业务模式主要为：配套现货进行套期保值。

公司期货套保业务主要由全资子公司上海事聚贸易有限公司操作。

#### **三、交易场所和操作品种**

套保业务平台为上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所及经过公司董事会核准的其他交易平台。操作品种包括公司现货相关的金属、农副产品。

#### **四、投资期限与投资金额**

##### **（一）投资期限**

自本议案获董事会审议通过之日起1年。

##### **（二）投资金额**

保证金投入金额不超过3000万人民币。

#### **五、开展期货套保业务的基本原则**

1、现货品种套保业务应在配套现货的数量及计划范围内进行操作。相关操作需在公司董事会审批授权下进行。

2、公司董事会授权上海事聚贸易有限公司董事长负责公司期货账户开立、操作总体计划及日常运作管理。

## **六、会计政策和核算原则**

公司及下属子公司开展期货套保业务选择的交易所和交易品种市场透明度高，成交活跃，流动性强，成交价格和结算价能够充分反映期货衍生品的公允价值。

公司根据《企业会计准则第 22 号-金融工具确认和计量》《企业会计准则 第 24 号-套期保值》《企业会计准则第 39 号-公允价值计量》对金融衍生品的公允价值予以确定。

## **七、风险分析和风险控制措施**

公司进行商品期货套期保值业务不以投机为目的，主要为有效规避价格波动对公司带来的不利影响，但同时也会存在一定的风险：

1、价格波动风险：当期货行情大幅剧烈波动时，期现走势背离，短期内造成部分价差损失。

2、穿仓风险：当行情剧烈波动并向期货持仓不利的方向快速发展时，或因保证金不足而被强行平仓，造成穿仓损失。

3、交割风险：临近交割而持仓超出交易所限仓时，或因合约流动性不足而造成平仓损失。

针对以上风险，主要管控手段如下：

1、期货业务开展各项流程环节须严格按照《套期保值业务管理制度》进行。

2、期货业务部管理公司期货业务操作。通过交易员与结算员、会计、风险控制部等的多方相互稽核的关系，建立有效交叉监督机制。套保业务各岗位人员，如发现套保业务交易存在违规操作时，应立即向上级领导汇报。

3、对期货操作进行授权管理，公司董事会根据上海事聚贸易有限公司的经营目标，审批、授权期货操作权限。风险控制部负责日常监控期货操作情况，若出现超权限的操作行为，风险控制部需及时向董事会汇报，根据董事会指示意见，可不执行指令或采取强制平仓等措施。

4、在制作仓单及申请套保额度方面做好提前量，公司每日对持仓情况进行

跟踪及反馈，对可能出现的交割风险制定应急处理预案。

5、匹凸匹金融信息服务（上海）股份有限公司审计部根据以上原则对相关账单进行定期核查，如有异常，应及时向公司董事会汇报。

#### **八、备查文件**

《第七届董事会第三十一次会议决议》

特此公告

匹凸匹金融信息服务（上海）股份有限公司董事会

二〇一六年八月十日