

上海钢联电子商务股份有限公司

关于调整控股子公司套期保值业务额度的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

上海钢联电子商务股份有限公司（以下简称“公司”）于 2017 年 9 月 7 日召开的第四届董事会第五次会议审议通过了《关于调整控股子公司套期保值业务额度的议案》，相关情况如下：

2017 年 6 月 8 日召开的第四届董事会第三次会议审议通过了《关于控股子公司继续开展套期保值业务的议案》（公告编号：2017-055），同意公司控股子公司上海钢银电子商务股份有限公司（以下简称“钢银电商”）继续使用保证金不超过人民币 2,000 万元开展期货套期保值业务，套期保值的交易数量不超过 50,000 吨。

鉴于本年度钢材价格上涨以及钢银电商平台交易量不断增加，为更有效的开展钢材套期保值业务，规避钢价波动对公司经营业绩的影响，钢银电商拟将套期保值业务保证金额度由目前的不超过 2000 万元增加至不超过 5,000 万元；套期保值的交易数量由目前不超过 50,000 吨增加至不超过 80,000 吨。该议案尚需提交股东大会审议，自股东大会通过之日起一年内有效。

一、钢银电商开展钢材套期保值业务的目的

钢银电商作为钢材现货电商交易平台，为保持钢银电商平台销售

的连续性，钢银电商建立了一定数量的基础库存，为规避钢价波动对公司经营业绩的影响，钢银电商开展钢材套期保值业务。

二、套期保值的品种和数量

1、交易品种：上海期货交易所上市的螺纹钢、热卷等期货。

2、建仓方向：授权钢银电商在采购销售螺纹钢、热卷等相关钢材品种期间进行钢材期货卖出套期保值交易。

3、交易数量：卖出套期保值的交易数量不超过 80,000 吨，且期货持仓量原则上应不超过现货量。

4、保证金控制在 5,000 万元以内。

5、资金来源：钢银电商将利用自有资金进行钢材套期保值业务。

6、套期保值期间：自股东大会审议通过之日起一年。

三、套期保值业务的风险分析

1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，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，可能会带来保证金不足的资金风险。

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的风险。

4、技术风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险。

四、风险控制措施

1、钢银电商将套期保值业务与其经营业务相匹配，最大程度对冲价格波动风险。钢银电商套期保值业务只限于在境内期货交易所交

易的钢材商品期货。

2、钢银电商将按照相关资金管理制度，合理调度和严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。钢银电商自本议案股东大会通过之日起一年内，各项套期保值业务必须严格限定在经批准的套期保值计划内进行，不得超范围操作。

3、公司将严格按照相关内控制度安排和使用专业人员，建立严格的授权和岗位牵制制度，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

4、公司设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，确保交易系统的正常运行，确保交易工作的正常开展，当发生故障时，即使采取相应的处理措施以减少损失。

套期保值业务的风险影响事件，本公司将及时进行公告。

五、公允价值的确定原则

公司钢材套期保值公允价值根据每一会计报告期最后一个交易日的结算价确定。

六、会计政策及核算原则

公司根据财政部颁布的《企业会计准则》规定的会计政策对钢材套期保值业务进行会计核算。

七、相关审核及批准程序

2017年9月7日召开的第四届董事会第五次会议、第四届监事会第五次会议审议《关于调整控股子公司套期保值业务额度的议案》。本议案尚需提交股东大会审议通过。本议案自股东大会通过之日起一

年内有效。

独立董事对该议案进行了事前审核并发表了独立意见：公司已制定《套期保值业务管理制度》，通过加强内部控制，落实风险防范措施，提高经营管理水平，为公司期货套期保值业务制定了具体操作规程。钢银电商选择利用期货工具的避险保值功能，开展套期保值业务，可有效降低市场价格波动风险，本次根据钢材市场和公司经营实际情况调整套期保值额度，符合公司和全体股东的利益。我们同意本次套期保值业务事项。

八、备查文件

- 1、公司第四届董事会第五次会议决议；
- 2、公司第四届监事会第五次会议决议；
- 3、独立董事对相关事项的事前认可和独立意见。

特此公告。

上海钢联电子商务股份有限公司

董事会

2017年9月7日