

江苏东方盛虹股份有限公司 关于 2019 年度开展期货套期保值业务的公告

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。

江苏东方盛虹股份有限公司（以下简称“公司”）于2019年6月21日召开第七届董事会第三十二次会议，审议通过了《关于2019年度开展期货套期保值业务的议案》，同意公司及其控股子公司2019年度开展期货套期保值业务累计投入保证金不超过人民币10,000.00万元。公司独立董事对本事项发表了表示同意的独立意见。

根据《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所主板规范运作指引》及《公司章程》等有关规定，本事项无需提交股东大会审议。

一、期货套期保值业务情况

1、开展期货套期保值业务的企业：公司及其控股子公司。

2、套期保值的期货品种：精对苯二甲酸（PTA）、乙二醇（MEG）期货交易合约。

3、年度投入资金：2019 年度，公司及其控股子公司开展期货套期保值业务累计投入保证金不超过人民币 10,000.00 万元。

4、资金来源：自有资金。

5、开展模式：由具体实施部门或企业组织建立工作小组管理期货套期保值业务的相关事宜，按照公司制定的《商品期货套期保值业务管理制度》相关规定及流程进行操作。

二、期货套期保值业务的必要性与可行性分析

1、必要性分析

公司作为大宗商品的采购商和生产商，生产经营相关的产品、原材料 PTA、MEG 为石化产品，受上游原油价格的波动以及市场供需变化的影响，市场价格存在较大的波动。为有效控制经营风险，提高公司抵御市场波动的能力，公司及其

控股子公司进行与生产经营相关的产品、原材料的期货套期保值业务，具有一定的必要性。

2、可行性分析

由于公司生产经营相关的产品、原材料价格受市场波动影响较大，并且与期货品种具有高度相关性，公司从事期货套期保值投资选择的交易场所和交易品种市场公开透明，成交积极活跃，流动性较强，公司董事会认为公司及其控股子公司通过开展期货套期保值交易业务规避价格波动风险是切实可行的，对生产经营是有利的。

三、期货套期保值业务的风险分析

1、价格异常波动风险：理论上交易品种在交割期的期货市场价格和现货市场价格会回归一致，但在极个别的非理性市场情况下，可能出现期货和现货价格在交割期仍不能回归，从而对公司的套期保值方案带来影响，甚至造成损失。

2、流动性风险：期货交易如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为不能及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失。期货交易可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

3、操作风险：由于期货交易专业性较强，复杂程度较高，存在因信息系统或内部控制方面的缺陷而导致意外损失的可能。

4、信用风险：价格出现对交易对方不利的大幅度波动时，交易对方可能违反合同的相关规定取消合同，造成公司损失。

5、法律风险：因相关法律制度发生变化或交易对方违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

四、公司采取的风险控制措施

1、套期保值业务仅以规避商品价格风险为目的，不涉及投机和套利交易，同时严格遵循进行场内交易的规定，进行套期保值业务只限于在与公司生产经营所需的原材料及主要产品相关的期货品种。

2、严格控制套期保值的资金规模，在公司董事会批准的额度内合理计划和使用保证金，将期货套期保值业务与公司经营业务相匹配，对冲原材料及产品价格波动风险。

3、设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展。当发

生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。

4、公司制定《商品期货套期保值业务管理制度》对期货业务进行管理，通过实行授权、岗位牵制和内部审计等措施进行风险控制。同时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，形成高效的风险处理程序。

五、对公司经营的影响分析

公司及其控股子公司通过开展PTA、MEG期货套期保值业务，可以充分利用期货市场的套期保值功能，降低原材料及产品价格波动风险，更好地规避原材料及产品价格涨跌给公司经营带来的风险，降低其对正常经营的影响。

公司将根据财政部《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——套期会计》、《企业会计准则第37号——金融工具列报》等相关规定及其指南，对套期保值业务进行相应的核算处理，反映财务报表相关项目。

六、独立董事意见

1、本次会议的召集、召开以及议案的审议、表决程序均符合相关法律、行政法规和《公司章程》的规定。

2、公司制定了期货套期保值相关的内控管理制度，对期货套期保值业务的组织机构、业务操作流程、审批流程等作出了明确规定，并制定了相关风险控制措施。在保证正常生产经营的前提下，公司及其控股子公司使用自有资金开展PTA、MEG期货套期保值业务，有利于控制经营风险，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。

我们同意 2019 年度公司开展期货套期保值业务事项。

七、备查文件

- 1、公司第七届董事会第三十二次会议决议；
- 2、独立董事独立意见。

特此公告。

江苏东方盛虹股份有限公司
董 事 会
2019 年 6 月 22 日