

股票简称：新金路

股票代码：000510

编号：临 2020—17 号

四川新金路集团股份有限公司 关于 2020 年度开展 PVC 期货套期保值业务的公告

本公司及董事局全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

四川新金路集团股份有限公司（以下简称“公司”）第十届第十六次董事局会议，审议通过了《关于公司 2020 年度开展 PVC 期货套期保值业务的议案》，根据《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》等相关规定，结合公司业务发展的实际情况，公司决定 2020 年度继续开展 PVC 期货套期保值业务，具体情况如下：

一、开展期货套期保值业务的目的

PVC 树脂是公司主导产品，为充分利用期货套期保值工具来规避和减少 PVC 市场价格波动给公司带来的经营风险，确保公司稳健发展。

二、套期保值的期货品种

公司期货套期保值业务仅限于境内期货交易所交易的 PVC 商品期货品种。

三、套期保值的额度

公司从事 PVC 期货套期保值业务的资金来源于公司生产经营的自有资金，进行 PVC 期货套期保值的最高保证金不超过人民币 3,000 万元（包括交割当期头寸而支付的全额保证金）。

四、授权期限

公司董事局授权公司期货领导小组按照公司《期货套期保值管理制度》相关规定，组织实施 PVC 期货套期保值业务。授权期限自本次董事会审议通过之日起 12 个月内。

五、会计政策及核算原则

公司套期保值业务的相关会计政策及核算原则将严格按照《企业会计准则》相关规定执行，对开展的套期保值业务进行相应的核算处理。

六、套期保值的风险分析

公司开展套期保值业务，以从事套期保值为原则，不以套利、投机为目的，主要是用来回避现货交易中价格波动所带来的风险。但同时也可能存在以下主要风险：

（一）价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成投资损失。

（二）流动性风险：可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

（三）内部控制风险：套期保值专业性较强，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。

（四）资金风险：如投入金额过大，可能造成企业资金流动性风险，甚至因为未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失。

（五）操作风险：由于错误或不完善的操作造成错单给公司带来损失。

（六）技术风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险。

七、采取的风险控制措施

（一）将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。期货持仓量不超过套期保值的现货量，持仓时间应与现货保值所需的计价期相匹配。

（二）合理选择期货保值月份。重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

（三）合理计划和安排使用保证金，保证套期保值过程正常进行；公司套期保值业务具体操作人每日密切关注套期保值头寸持仓风险，按照期

货交易所及期货公司、大宗交易的要求及时做好保证金的追加工作。当出现由于保证金不足将被强行平仓的情况时，公司启动快速决策机制，直接调拨资金追加保证金。

（四）严格按照公司《期货套期保值管理制度》相关规定，合理设置套期保值业务组织机构，建立岗位责任制，明确各相关部门和岗位的职责权限，并及时识别相关的内部控制缺陷并采取补救措施。

（五）建立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，保证交易系统正常运行，当发生错单时，及时采取相应措施处理。

八、独立董事意见

独立董事认为：在保证正常生产经营的前提下，公司使用自有资金开展 PVC 期货套期保值业务，有利于锁定公司的生产成本，控制经营风险，提高公司抵御市场波动和平抑价格震荡的能力，公司建有《期货套期保值管理制度》，就公司开展 PVC 期货套期保值业务的行为明确了组织机构、业务操作流程、审批流程及风险控制措施，同意公司开展 PVC 期货套期保值业务。

九、备查文件

- （一）公司第十届第十六次董事局会议决议。
- （二）公司独立董事意见书面文件。
- （三）公司套期保值可行性分析报告。

特此公告

四川新金路集团股份有限公司董事局

二〇二〇年四月三十日