

北京绵石投资集团股份有限公司 关于公司衍生品交易事项的公告

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

2016 年 12 月 21 日，公司第八届董事会第二十次临时会议审议通过《关于未来一年内公司衍生品交易事项的议案》，同意公司在未来一年内可以继续开展股指期货投资业务。

现将本次衍生品交易事项的具体情况公告如下：

一、衍生品投资概述

（一）投资目的

根据公司第八届董事会第二十次临时会议审议通过的决议，未来一年内公司拟继续利用部分闲置资金参与证券市场投资。故本次股指期货投资仍以套期保值为主要目的，依靠股指期货投资做多和做空的功能，在采取科学严格的风险控制手段的前提下，能够有效锁定公司证券投资的投资成本，对冲投资的风险，并争取获得稳健的收益。

（二）投资范围

公司衍生品投资的对象仍为中国金融期货交易所上市的股指期货，其合约期限、履约担保、交易杠杆倍数、流动性安排、清算交收原则、支付方式及违约责任均依照中国金融期货交易所的标准化合同确定。

（三）投资额度

根据前述董事会会议决议，公司如参与股指期货投资，可动用的保证金总额不超过人民币 500 万元，即不超过截止 2016 年 6 月 30 日公司经审计净资产的 0.36%。

（四）投资期限

投资期限为自本项投资事项经董事会审议通过之日起一年。

（五）投资方式

本投资事项将在上述额度内，由公司副总经理负责组织相关部门和人员具体实施。

二、公司股指期货投资的管理情况

1、公司已制定《证券投资管理办法》，对公司包括股指期货等衍生品投资的风险控制、审议程序、后续管理等进行明确规定，以有效规范衍生品投资行为，控制衍生品投资风险。

2、为保证公司股指期货投资工作的顺利进行，最大限度的控制风险，公司成立了以副总经理为首的股指期货投资工作小组，并已经配备投资决策、业务操作方面的专业人员，具体负责金融衍生品投资事务，并按照董事会的授权及《证券投资管理办法》的规定开展投资活动。

3、公司投资工作小组成员已充分理解股指期货投资的特点和潜在风险，严格执行相关的业务操作和风险管理制度。工作小组的成员对股指期货投资在投资操作、风险防控等方面的认识较为深入，熟悉相关工作程序，有利于下一步的投资工作的开展。

4、公司投资工作小组成员将根据证券市场发展和公司证券投资工作进展的实际情况，灵活选择适当的进入和退出时机、开展股指期货投资，在争取收益的同时，最大限度的避免风险。

三、公司股指期货投资的风险分析

1、市场风险：公司开展的股指期货投资业务，主要为与公司证券业务相关的套期保值类业务，存在市场价格波动导致金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险。

2、流动性风险：目前公司的资金情况较为良好，而参与股指期货所动用的资金量较小，不会影响公司各项正常业务的开展，基本不存在流动性方面的风险。

3、履约风险：公司股指期货投资交易是在中国金融期货交易所进行，基本无履约风险。

4、其他可能的风险：在具体开展业务时，如发生操作人员未准确、及时、完整地记录股指期货投资业务信息，将可能导致衍生品业务损失或丧失交易机会；同时，如交易人员未能充分理解交易合同条款和产品信息，将面临因此带来的法律风险及交易损失。对此，经过较长时期的实际操作，公司相关投资人员对于股指期货的交易特点、交易程序等均已较为熟悉，发生前述风险的可能性不大。

四、风险管理措施

综上，公司本次股指期货投资，主要面临的是证券市场变动所可能产生的风险。对此，公司将严格按照董事会的授权及《证券投资管理辦法》的规定，开展股指期货的投资活动；严格履行相应的审批监管程序；及时关注证券市场变化，进一步提高对证券市场的研究水平；根据市场变化情况及时调整投资策略；制定程序化的交易策略；规范投资操作，最大限度的避免风险的发生。

五、公司股指期货投资的公允价值分析

公司进行的股指期货投资，其公允价值按照中国金融期货交易所提供的价格厘定。

六、公司股指期货投资的会计政策及核算原则

公司根据《企业会计准则》和公司会计政策的相关规定，对股指期货投资业务进行适当处理，并按规定进行信息披露。

七、衍生品交易对公司影响

公司开展衍生品交易事项，目的在于利用股指期货投资做多和做空的功能，在严格控制风险的基础上，控制公司证券投资的投资成本，对冲投资的风险，为公司和广大股东争取获得稳健的收益。

八、独立董事意见

公司独立董事袁宇辉、刘燃、陈持平审议了未来一年内公司衍生品交易事项的议案，并发表了独立意见：

通过审议，公司独立董事认为，公司衍生品交易事项主要是以套期保值为目的，进一步防控公司参与证券市场投资所可能产生的风险，并为公司创造更加良好的投资收益。该事项及其审议程序符合《公司章程》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《信息披露业务备忘录第 26 号——衍生品投资》等法律法规、规范性文件的规定；同时独立董事也提醒公司，前述投资事项应严格按照公司董事会决议及相关内控制度的内容实施。

对于前述投资事项，公司独立董事一致表示同意。

九、备查文件

- 1、北京绵石投资集团股份有限公司第八届董事会第二十次临时会议决议；
- 2、北京绵石投资集团股份有限公司关于继续动用部分闲置资金参与证券市场投资、及关于未来一年内公司衍生品交易事项的独立董事意见。

特此公告。

北京绵石投资集团股份有限公司

董 事 会

2016 年 12 月 21 日