

浙江天杰实业股份有限公司 关于继续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公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。

浙江天杰实业股份有限公司（以下简称“公司”）于2019年9月20日召开了第二届董事会第五次会议，会议审议通过了《关于继续开展期货套期保值业务的议案》，同意公司继续开展主要材料套期保值业务，现将有关情况公告如下：

一、开展套期保值业务的目的和必要性

公司所处行业为电气机械和器材制造业（信息通信电线电缆制造），生产经营过程中需要使用大量的铜、铝以及PE、PVC等材料，由于目前有色金属市场以及塑料市场价格波动较大，对公司生产经营所需的原料产生直接而重大的影响，在很大的程度上决定着公司的生产成本及效益，因此，公司需继续从事商品期货交易（原套保业务一年授权期限已将满），通过充分利用期货市场的套期保值功能，规避公司生产经营所涉及的价格波动风险，合理规避给公司经营带来的不利影响，确保公司生产经营的正常稳定进行。

公司2018年10月11日召开的2018年第一次临时股东大会审议通过了《关于公司开展套期保值业务的议案》，所授权限时间即将

到期，根据公司套期保值制度的规定，结合公司业务发展的需要，拟继续使用保证金不超过 500 万元开展期货套期保值业务。

二、套期保值的品种

根据公司对近几年主要原材料铜、铝以及 PE、PVC 的现货价格走势分析，其与期货市场的价格走势虽不完全一致，但相关性较高。因此公司拟选择上海期货交易所的铜、铝以及 PE、PVC 进行套期保值业务，尽可能规避主要原材料的价格波动风险。

三、套期保值交易的有效期

本议案自 2019 年第二次临时股东大会审议通过一年后有效。

四、套期保值的金额

根据公司对近三个业务年度铜、铝、PE、PVC 等主要原料的统计及对来年发展的预判，保证金计划最高投入不超过人民币 500 万元，所有资金均为公司自有资金。

五、套期保值风险情况

1、市场风险：期货市场自身存在着一定的系统性风险，同时套期保值需要对价格走势做出一定的预判，一旦价格预测发生方向性错误有可能会给公司造成损失。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。

3、内部控制风险：期货交易专业性强，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：由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应风险。

六、套期保值内部控制措施

1、公司的套期保值业务规模将与公司经营业务相匹配，最大程度对冲价格波动风险。期货套期保值交易仅限于与公司生产经营所需材料相关度较高的商品期货品种。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，在市场剧烈波动时及时平仓规避风险。期货保证金最高占用规模不超过500万元。

3、建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。

综上所述，我们认为公司将套期保值业务作为公司有效防范和化解原材料市场价格波动风险的有效工具，通过加强内部控制和管理，落实风险防范措施，提高经营水平，有利于公司实现持续稳定的经营效益，公司参与期货套期保值交易是必要的，风险是可以控制的。

七、备查文件

经与会董事签字确认的公司《第二届董事会第五次会议决议》。
特此公告。

浙江天杰实业股份有限公司

董事会

2019年9月20日