

## 青岛天能重工股份有限公司 关于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。

青岛天能重工股份有限公司（以下简称“公司”）于2018年11月30日召开第三届董事会第九次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，同意公司使用自有资金开展钢材套期保值业务，业务期间为2018年12月1日至2019年11月30日。现将相关情况公告如下：

### 一、期货套期保值的目的和必要性

公司生产所需主要原材料为钢材（中厚板），钢材成本可占公司塔筒生产成本的60%以上。钢材价格波动对公司的生产成本影响较大，公司开展相关钢材套期保值业务，主要是为了锁定公司产品成本，有效地防范和化解由于原材料价格变动带来的市场风险，减少因原材料价格波动造成的产品成本波动，降低原材料价格波动对公司正常经营的影响。

### 二、拟开展的期货套期保值业务情况

1、期货套期保值交易品种：在上海期货交易所交易的热轧卷板和螺纹钢期货品种。

2、业务期间：2018年12月1日至 2019年11月30日。

3、预计交易数量及投入金额：

公司期货领导小组将根据业务需求及市场情况，在上述期限内对不超过15万吨的热轧卷板或螺纹钢开展期货套期保值，相关情况如下：

- （1）预计当期套期保值数量：不超过15万吨；
- （2）拟套期保值最高持仓数量：不超过15万吨；
- （3）累计投入保证金及后续护盘资金不超过5000万元。

### 三、期货套期保值业务的开展

由公司董事会授权组织建立的公司期货领导小组，作为管理公司期货套期保值业务

的决策机构，按照公司《期货套期保值管理制度》相关规定及流程进行操作。

1、公司将合理调度自有资金用于期货套期保值业务，不使用募集资金直接或间接进行套期保值。

2、公司从事期货套期保值业务，只在上海期货交易所场内市场进行，不在场外市场进行。

3、公司将严格遵循锁定原材料价格波动风险进行期货套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作。

4、公司进行套期保值的数量原则上不得超过实际现货交易的数量，期货持仓量应不超过套期保值的现货量的原则。

5、公司的期货套期保值业务将根据财政部《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—套期保值》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》等相关规定进行会计处理。

#### 四、期货套期保值业务的风险分析

公司进行期货套期保值业务存在价格波动、资金、内部控制、技术、客户违约、政策等方面的风险，具体如下：

1、价格波动风险：当期货行情大幅剧烈波动时，公司可能无法在要求锁定的价格买入套保或在预定的价格平仓，造成损失。

2、资金风险：期货交易按照公司《期货套期保值管理制度》中规定权限下达操作指令，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，此外，在期货价格波动巨大时，公司甚至可能存在未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失的风险。

3、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内部控制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，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题。

5、客户违约风险：期货价格出现不利的大幅波动时，客户可能违反合同的相关约定，取消产品订单，造成公司损失。

6、政策风险：期货市场法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无

法交易，从而带来相关风险。

## 五、公司拟采取的风险控制措施

1、将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲原材料价格波动风险。公司的期货套期保值业务只限于上海期货交易所交易的热轧卷板和螺纹钢期货合约，严禁进行以逐利为目的的任何投机交易。

2、公司将合理调度自有资金用于期货套期保值业务，不使用募集资金直接或间接进行期货套期保值。如拟投入资金有必要超过人民币 5000 万元的，应将关于增加期货套期保值的投入金额及具体实施方案提交董事会审议批准，并按公司《期货套期保值管理制度》的规定执行。

3、公司已根据《深圳证券交易所创业板股票上市规则》等有关规定，结合公司实际情况，制定了《期货套期保值管理制度》，对套期保值业务额度、品种范围、审批权限、内部审核流程、责任部门及责任人、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等作出明确规定。公司将严格按照《期货套期保值管理制度》规定对各个环节进行控制。

4、公司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。

5、根据生产经营所需及客户订单周期作为期货交易操作期，降低期货价格波动风险。

6、加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，及时合理地调整套期保值思路与方案。

## 六、相关审核和批准程序

1、董事会意见：2018 年11月30日，公司第三届董事会第九次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，董事会认为，公司开展相关钢材套期保值业务，有利于锁定公司产品成本，有利于防范和化解由于原材料价格变动带来的市场风险，减少因原材料价格波动造成的产品成本波动。董事会同意公司使用自有资金开展钢材套期保值业务。

2、监事会意见：2018年11月30日，公司第三届监事会第八次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，监事会认为，公司开展期货套期保值业务的相关审

批程序符合国家相关法律法规、《公司章程》及公司《期货套期保值业务管理制度》的规定，设置了相应的风险控制措施，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

3、独立董事意见：公司使用自有资金利用期货市场开展针对原材料钢材的期货套期保值业务的相关审批程序符合国家相关法律法规、《公司章程》及公司《期货套期保值业务管理制度》的规定。公司开展的期货套期保值业务有利于充分发挥公司竞争优势，提高公司抵御市场波动和平抑原材料价格震荡的能力，不存在损害公司和全体股东利益的情形，同时公司制定了有效的风险防控措施，公司开展针对原材料钢材的期货套期保值业务是可行的。因此，同意公司开展针对原材料钢材的期货套期保值业务。

4、保荐人核查意见：

经核查，保荐机构认为：

(1) 公司开展期货套期保值业务符合公司实际经营的需要，可以在一定程度上降低原材料价格波动对公司正常经营的影响；

(2) 公司根据相关规定及实际情况制定了《期货套期保值业务管理制度》，针对套期保值业务内部管理的制度较为完备，具有相应的风险控制措施；

(3) 本次事宜已经公司第三届董事会第九次会议审议通过，独立董事和监事会发表了明确同意意见，履行了必要的审批程序，符合《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《深圳证券交易所创业板上市公司规范运作指引》等相关法律法规的规定；

综上所述，保荐机构对公司此次期货套期保值业务相关事项无异议。

## 七、 备查文件

- 1、青岛天能重工股份有限公司第三届董事会第九次会议决议
- 2、青岛天能重工股份有限公司第三届监事会第八次会议决议
- 3、青岛天能重工股份有限公司独立董事关于公司开展期货套期保值业务的独立意见

4、广州证券股份有限公司关于青岛天能重工股份有限公司开展期货套期保值业务的核查意见

特此公告。

青岛天能重工股份有限公司董事会

2018年11月30日