

证券代码：603906

证券简称：龙蟠科技

公告编号：2019-009

江苏龙蟠科技股份有限公司

关于公司及子公司、控股孙公司开展期货套期保值业务的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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责任。

江苏龙蟠科技股份有限公司（以下简称“公司”）于2019年1月7日召开了第二届董事会第十八次会议，审议通过了《关于公司及子公司、控股孙公司开展期货套期保值业务的议案》，现将具体内容公告如下：

一、开展期货套期保值业务的目的及必要性

乙二醇是公司、子公司及控股孙公司主营产品发动机冷却液的主要原材料之一，为减少乙二醇现货市场价格波动，降低生产经营中主要原材料价格波动的风险，公司及子公司、控股孙公司拟开展期货套期保值业务，充分利用期货的套期保值功能，减少因原材料价格波动造成的产品成本波动，进而提升公司生产经营水平和抗风险能力，确保公司及子公司、控股孙公司生产运营稳定运行。

二、开展期货套期保值业务的交易额度和期限

公司及子公司、控股孙公司拟开展的期货保值业务只限于大连商品交易所交易的乙二醇期货品种，根据公司及子公司、控股孙公司生产产品原材料需求测算，拟对不超过20,000吨乙二醇期货保值，期货保证金金额不超过人民币2,000万元。期限自董事会审议通过之日起一年，并授权公司管理层在本次授权范围内根据公司业务情况、实际需求开展套期保值业务，公司套期保值业务使用自有资金进行操作。针对保值中存在的价格波动风险，允许在董事会决议范围内开展对冲保值。

三、开展套期保值业务的风险分析

公司及子公司、控股孙公司开展期货套期保值业务以对现货保值为目的，主要为有效减少原材料及产品价格波动对公司带来的不利影响，但同时也会存在一定的风险：

（一）价格波动风险

在期货行情变动较大时，公司可能无法实现在材料锁定价格或其下方买入套保合约，造成损失。

（二）政策风险

有关期货市场的法律法规等相关政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来风险。

（三）流动性风险

期货交易中，受市场流动性不足的限制，期货交易可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动风险。

（四）操作风险

期货交易专业性较强，可能存在操作不当或操作失败的风险。

（五）技术风险

由于无法控制或不可预测的系统、网络、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，从而带来相应的风险和损失。

四、公司采取的风险控制措施

（一）公司及从事套期保值业务的子公司、控股孙公司制定了较为完善的期货套期保值业务的相关管理制度，通过严格的内部控制执行，形成较为完整的风险控制体系。

（二）根据公司经营需求，期货保值业务严格按照董事会审议的范围及数量执行，且只限于在期货交易所交易，禁止进行期货投机交易。

（三）合理设置公司期货业务组织架构，建立岗位责任制，明确各相关部门的权限和职责，且需要加强相关人员的专业知识培训，提高相关人员的专业素养。同时，建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序。

（四）建立公司期货业务的授权审批制度和业务流程，严格按照规定程序进行保证金及清算资金的收支。

（五）严格控制套期保值业务的资金规模，合理计划和安排使用保证金，保证套期保值业务过程正常进行。同时，合理选择保值时点，避免市场流动性风险。

（六）在业务操作过程中，严格遵守国家有关法律法规的规定，防范法律风险，定期对期货套期保值业务的规范性、内控机制执行的有效性等方面进行监督检查。

五、独立董事意见

公司独立董事认为：公司及子公司、控股孙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、法规及《公司章程》的有关规定，公司已制定了《期货套期保值业务管理制度》，通过加强内部控制，落实风险防范措施，为从事套期保值业务制定了具体操作流程。套期保值业务的开展，能有效降低原材料价格波动的风险，充分利用期货市场套期保值的功能，降低产品价格波动对公司的影响，不存在损害公司和全体股东利益的情形。因此，我们同意开展期货套期保值业务。

六、备查文件

- 1、第二届董事会第十八次会议决议
- 2、独立董事关于公司第二届董事会第十八次会议相关事项的独立意见

特此公告。

江苏龙蟠科技股份有限公司董事会

2019年1月9日