

## 三力士股份有限公司

### 关于开展 2019 年度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。

三力士股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 4 月 22 日召开了第六届董事会第十七次会议和第六届监事会第十四次会议，审议通过了《关于开展 2019 年度期货套期保值业务的议案》，同意公司 2019 年度开展不超过 4,000 万元投资额度的天然橡胶套期保值业务。现将有关情况公告如下：

#### 一、套期保值的目的

公司的主营业务为非轮胎橡胶制品的研发、生产与销售，主要产品为橡胶 V 带，对生产经营所需要的原材料“橡胶”需求很大。而橡胶的市场价格波动较大，为尽可能规避生产经营中的原材料成本大幅波动风险，公司决定开展套期保值业务，尽量减少因原材料价格波动造成的产品成本波动，保证产品成本的相对稳定，降低原材料价格波动对公司经营业绩的影响。

#### 二、期货品种和规模

公司本次套期保值业务的期货品种为天然橡胶，总规模不超过 4,000 万元。

#### 三、业务开展的期限

套期保值业务期间为 2018 年度股东大会召开之日起至 2019 年度股东大会召开之日止。

#### 四、套期保值的风险分析

##### 1. 期货价格波动风险

期货价格波动风险指公司购入天然橡胶套期保值仓位后，由于突发不利因素造成期货价格在短期内出现大幅下跌，造成公司被迫平仓而产生较大损失或公司无法通过交割现货实现盈利。

##### 2. 操作不当风险

操作不当风险是指公司内部控制制度不严密或操作未严格按内部控制制度执

行，造成橡胶套期保值业务出现亏损。

## 五、公司采取的风险控制措施

### 1. 期货价格波动风险应对措施

根据橡胶实际用量以及发展新业务需要，公司规定了套期保值持仓总手数不超过 400 手，即 4,000 吨。同时，公司也将在购入橡胶期货的价格上严格控制。

### 2. 操作不当风险应对措施

公司制定并完善了《境内期货套期保值内部控制制度》，对公司期货套期保值业务的组织机构、授权制度、业务流程、风险管理制度、报告制度、档案管理制度、保密制度、合规检查制度等内容进行了详细的规定。同时董事会授权总经理建立了公司期货领导小组，并设置了套期保值业务组织架构，包括交易员、结算员、风险管理员、资金调拨员、交易确认员、会计核算员、档案管理员等，对公司期货业务流程亦做出了详细的规定。

在风险控制方面，公司设置了风险管理员岗位，制定了风险管理员主要职责；在已经确认对实物合同进行套期保值的情况下，期货头寸的建立、平仓要与所保值的实物合同在数量上及时间上相匹配；同时公司建立了风险测算系统，对资金风险和保值头寸价格变动风险也作出了严格要求；公司为应对当市场价格波动较大或发生异常波动的情况，还建立了内部风险报告制度和风险处理程序，以及时采取应对措施。

## 六、独立董事意见

经核查，公司独立董事认为：公司主营业务为非轮胎橡胶制品的研发、生产和销售，主要产品为橡胶 V 带，在保证正常生产经营的前提下，公司开展天然橡胶套期保值业务，有利于公司规避原材料采购价格波动所产生的风险，减少公司因原材料价格波动给公司经营造成的影响，实现公司长期稳健发展。因而，公司开展期货套期保值业务不存在损害公司及全体股东利益的情形，同意公司 2019 年度期货套期保值业务的开展。

## 七、保荐机构核查意见

经核查，保荐机构中天国富证券有限公司认为：公司开展与生产所需主要原材料橡胶的套期保值业务，有利于公司生产经营的正常开展；公司已按照《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》等有关规定，制定了期货内控管

理及运行管理制度，对套期保值业务作了明确规定，并制定了相关风险控制措施，相关内部控制和风险管理制度完善合规、风险控制措施有效；公司使用自有资金开展套期保值业务，其内部审批程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。保荐机构对公司本次开展期货套期保值业务事项无异议。

#### 八、备查文件

1. 公司第六届董事会第十七次会议决议；
2. 独立董事关于第六届董事会第十七次会议相关事项的独立意见；
3. 中天国富证券有限公司关于公司开展2019年度期货套期保值业务的核查意见。

特此公告。

三力士股份有限公司董事会

二〇一九年四月二十二日