

浙江万盛股份有限公司

关于公司及子公司开展原材料相关产品

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。

浙江万盛股份有限公司（以下简称“公司”）于2015年1月12日以通讯方式召开了第二届董事会第十次会议，审议通过了《关于公司及子公司开展原材料相关产品期货套期保值业务的议案》。现将有关套期保值情况公告如下：

一、套期保值的目的和必要性

公司以及子公司浙江万盛科技有限公司主要业务为阻燃剂的研发、制造和销售。近几年来，受国内宏观经济影响，原油系列原材料相关产品市场波动较大，为有效规避市场风险，对冲原材料相关产品价格波动对公司生产经营的影响，公司及子公司拟利用期货套期保值操作，进行风险控制，减少和降低原材料相关产品价格波动对生产经营的影响。

二、拟开展套期保值业务情况

公司及子公司拟开展的期货套期保值业务只限于郑州商品交易所、大连商品交易所、上海期货交易所旗下的能源交易所的高相关性期货品种。

公司及子公司自本次董事会审议通过之日起开始计算，连续12个月内原材料相关产品期货套期保值的数量不超过2万吨。期货保证金最高投入金额为2,000万元人民币，止损额度为600万元人民币。董事会授权公司期货领导小组按照《浙江万盛股份有限公司套期保值管理制度》组织实施原材料相关产品期货套期保值业务。

三、套期保值风险分析

1、价格波动风险

期货行情波动较大，如果利率、现货市场价格发生重大变化、时间跨度较长或者突发变化趋势或者任何一方的波动过于剧烈，导致二者的亏损无法完全对

冲，从而产生重大亏损。

2、政策风险

期货市场的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，从而带来的风险。

3、流动性风险

如果合约活跃度较低，导致套期保值持仓无法在合适的价位成交，令实际交易结果与方案设计出现较大偏差，从而带来损失。

4、操作风险

期货交易专业性较强，存在操作不当或操作失败，从而带来相应风险。

5、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。

四、公司拟采取的风险控制措施

1、根据具体走势采取期货与现货的错位操作等方式进行修正，公司将密切跟踪盘面期货价格走势，结合现货分析，合理定制止损位，弱化基差风险。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。

3、建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序，对套期保值方案已设定的建仓价格区间及其他条件，及时进行合理调整。

4、套期保值操作时选择主力合约进行操作并尽量选择远期合约进行对冲。

5、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。

6、牢固掌握商品交易所相关规定，积极配合交易所及相关部门的风险管理工作。

7、设立专门的风险控制岗位，强化内控制度的落实，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

8、设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，确保交易工作正常开展。当发生错单时，及时采取相应处理措施，并减少损失。

9、套期保值业务出现重大风险或可能出现重大风险，套期保值业务亏损金额每达到或超过公司最近一年经审计的归属于上市公司股东净利润的10%且亏

损金额达到或超过 500 万元人民币的，本公司将及时披露。

五、独立董事意见

1、公司及子公司使用自有资金利用期货市场开展与公司生产经营相关的产品套期保值业务的相关审批程序等符合相关法律法规和《公司章程》的有关规定。

2、公司已制定《浙江万盛股份有限公司套期保值管理制度》，建立健全了组织机构、业务操作流程、审批流程及风险控制措施。

3、在保证正常生产经营的前提下，公司及子公司以自有资金开展原材料相关产品期货套期保值业务，有利于有效规避市场风险，对冲原材料相关产品价格波动对公司生产经营的影响，实现公司自身长期稳健的发展。

公司独立董事认为，公司及子公司开展原材料相关产品期货套期保值业务不存在损害公司和全体股东利益的情形，同意其开展原材料相关产品期货套期保值业务。

六、备查文件目录

1. 《浙江万盛股份有限公司第二届董事会第十次会议决议》
2. 《浙江万盛股份有限公司独立董事关于公司及子公司开展原材料相关产品期货套期保值业务的独立意见》

特此公告。

浙江万盛股份有限公司董事会

二〇一五年一月十二日