

香港交易及結算所有限公司及香港聯合交易所有限公司對本公告的內容概不負責，對其準確性或完整性亦不發表任何聲明，並明確表示，概不對因本公告全部或任何部分內容而產生或因倚賴該等內容而引致的任何損失承擔任何責任。



廈門國際港務股份有限公司
XIAMEN INTERNATIONAL PORT CO., LTD*

(於中華人民共和國註冊成立之股份有限公司)

(股份代號：3378)

海外監管公告

本公告乃根據香港聯合交易所有限公司之證券上市規則第 13.10B 條之規定而發佈。

以下公告是由廈門國際港務股份有限公司旗下一間以其 A 股於深圳證券交易所上市之附屬公司，廈門港務發展股份有限公司而發放。

承董事會命
廈門國際港務股份有限公司
聯席公司秘書
蔡長軫

中國廈門，二零一七年一月二十四日

於本公告日期，本公司執行董事為林開標先生、蔡立群先生、方耀先生、陳朝輝先生及柯東先生；本公司非執行董事為鄭永恩先生、陳鼎瑜先生、傅承景先生及黃子榕先生；及本公司獨立非執行董事為劉峰先生、林鵬鳴先生、游相華先生、靳濤先生及季文元先生。

* 僅供識別

廈門港務發展股份有限公司

關於貿易公司2017年度開展套期保值業務的公告

本公司及董事會全體成員保證信息披露內容的真實、準確、完整，沒有虛假記載、誤導性陳述或重大遺漏。

本公司於2017年1月24日召開第五屆董事會第二十四次會議，會議審議通過了《關於貿易公司2017年度在保證金1000萬元人民幣額度內開展套保業務的議案》，同意公司全資子公司廈門港務貿易有限公司（以下簡稱“貿易公司”）2017年度開展商品期貨套期保值業務，現將相關情況公告如下：

一、套期保值業務的目的

貿易公司主要從事鋼材、白糖、化工原料、煤炭等大宗商品的貿易業務，隨著業務規模的不斷擴大，貿易公司擬借助期貨市場的價格發現和風險對沖功能，利用境內期貨市場開展期貨套期保值業務，從而更好地規避公司經營商品的價格波動所產生的風險，減少價格波動給公司經營業績造成的影響，保證公司業務穩步發展。

二、預計開展的套期保值業務概述

1、套期保值的交易市場

貿易公司僅限於在境內期貨交易所進行場內交易，不進行場外和境外交易；擬進行套期保值交易的現貨品種，僅限於在境內期貨交易所與貿易公司主營相關的大宗商品。目前貿易公司擬開展套期保值的產品主要為大連商品期貨交易所的LLDPE（線性低密度聚乙烯）、PP（聚丙烯），上海期貨交易所的卷板、螺紋鋼，和鄭州商品期貨交易所的白糖、動力煤等。

2、期貨品種

貿易公司的期貨套期保值業務，僅限於公司已持有的，或正在有效履行的購銷合同項下的與期貨品種同類的產品，限於鋼材、白糖、塑料米、煤炭等產品範圍內。

3、擬投入資金

2017年度內，貿易公司全年期貨套期保值保證金額度在人民幣1000萬元以

內（含追加的臨時保證金）。實際執行過程中，超年度套期保值計劃或超過 1000 萬元的，應重新履行審批程序。

4、資金來源

貿易公司將利用自有資金進行期貨套期保值業務。

三、履行合法表決程序的說明

2017年1月24日，本公司第五屆董事會第二十四次會議以8票贊成，0票反對，0票棄權審議通過了《關於貿易公司2017年度在保證金1000萬元人民幣額度內開展套保業務的議案》。該項套期保值業務不屬於關聯交易事項，無需履行關聯交易表決程序；該議案在董事會權限範圍內且為以套期保值為目的的衍生品投資，不需提交公司股東大會審議。

四、開展套期保值業務的主要條款

1、業務範圍：根據現貨需要開展鋼材、白糖、塑料、煤炭期貨標準合約的交易，不進行投機；

2、交易品種：只從事鋼材、白糖、塑料、煤炭期貨標準合約的交易，不進行場外交易；

3、交易所選擇：上海期貨交易所、鄭州期貨交易所、大連期貨交易所；

4、合約的交割：實物交割；

5、交易數量：根據公司業務經營的情況而定，總成交金額不超過7億元；

6、合約期限：不超過12個月；

7、交易杠杆倍數：按目前價格計算為10倍左右；

8、流動性安排和清算交易原則：根據建立頭寸所對應的到期日進行資金方面的準備，並按照期貨交易所相應的結算價格進行購入或賣出清算；

9、支付方式及違約責任：出現違約或者交易損失，按現金匯付結算；

10、履約擔保：以期貨交易保證金方式擔保。

五、開展套期保值業務的準備情況

1、貿易公司已制定《廈門港務貿易有限公司期貨套期保值業務內部控制制度》，套期保值工作按照以上制度嚴格執行；

2、貿易公司建立了完善的期貨套期保值業務決策、操作、監督等工作分工和控制機制。公司董事會是期貨業務的最高決策機構；貿易公司套期保值管理辦公室是期貨業務的日常管理機構，負責期貨業務的日常管理工作，確保相關人員

遵守有關制度；負責制定、執行套期保值交易方案。

六、開展套期保值業務的風險分析

1、市場風險：因期貨市場價格波動過大，造成保證金不足的風險；

控制措施：在制定交易方案時做好資金測算，做好實時監控。

2、信用風險：公司根據制度選擇經紀公司，所選擇的經紀公司運作規範信譽良好，發生信用風險的概率較小；

3、操作風險：公司在開展期貨套期保值交易業務時，如發生操作人員未按規定程序報備及審批，或未準確、及時、完整地記錄期貨業務信息，將可能導致期貨業務損失或喪失交易機會；

控制措施：公司選用合適人員從事期貨業務操作，降低操作風險。

4、法律風險：公司開展期貨業務交易時，存在交易人員未能充分理解交易合同條款和產品信息，導致經營活動不符合法律規定而造成的交易損失。

七、採取的風險控制措施

1、貿易公司制定《廈門港務貿易有限公司期貨套期保值業務內部控制制度》並嚴格執行；

2、嚴格規定該業務的操作程序，有效控制和規避操作風險；

3、為進一步加強套期保值業務管理工作，健全和完善期貨運作程序，確保公司經營目標的實現，形成了董事會、套期保值業務管理辦公室、合規檢查員、風險控制員、會計核算員、資金調撥員、交易員、檔案管理員、業務經理等多層次授權、制約和控制的業務流程，便於期貨業務風險的防範和控制；

4、公司對套期保值業務實行董事會授權管理，公司董事會授權總經理組織建立套期保值管理辦公室，在董事會授權框架內行使期貨套期保值業務管理職責。公司根據制訂的《廈門港務貿易有限公司期貨套期保值業務內部控制制度》的相關規定，公司關於套期保值為目的的期貨投資內部控制制度健全、完善，並建立了嚴格的風險分級報告制度和止損制度。內部控制組織架構設置科學合理，職權分工明確，套期保值計劃嚴格履行相應的審批程序，由公司業務部門負責擬定套期保值計劃和套期保值可行性，報告初步方案；由公司套期保值業務管理辦公室本著穩健經營、謹慎運作的原則，充分考慮公司的業務實際和資金狀況、風險是否可控後，對業務部門提出的套期保值計劃進行討論並提出修訂意見，修訂完善後，報總經理審批，並向董事會備案。因此，公司能夠將套期保值風險控制

在可控範圍內，能夠有效規避內部控制缺陷和風險。

八、期貨公允價值分析

公司衍生品交易所選擇的交易所和交易品種市場透明度大，成交活躍，流動性較強，成交價格和結算價能充分反映衍生品的公允價值。

九、會計政策及核算原則

公司根據《企業會計準則第22 號-金融工具確認和計量》、《企業會計準則第24 號-套期保值》對金融衍生品的公允價值予以確定。

十、獨立董事獨立意見

公司獨立董事審議了《關於貿易公司 2017 年度在保證金 1000 萬元人民幣額度內開展套保業務的議案》，發表獨立意見如下：

1、公司全資子公司貿易公司使用自有資金繼續開展套期保值業務的相關決策程序符合國家相關法律、法規及《公司章程》的有關規定。在保證正常生產經營的前提下，貿易公司開展該項業務有利於更好地規避公司經營商品的價格波動所產生的風險，減少價格波動給公司經營業績造成的影響，保證公司業務穩步發展。不存在損害公司和全體股東、尤其是中小股東利益的情形；

2、貿易公司已經制定了《廈門港務貿易有限公司期貨套期保值業務內部控制制度》，通過加強內部控制，落實風險防範措施，為公司從事套期保值業務制定了具體操作規程。貿易公司本次繼續開展套期保值業務是可行的，風險可控；

因此，獨立董事一致同意貿易公司 2017 年度在保證金 1000 萬元人民幣額度內開展套保業務。

十一、備查文件

- 1、經與會董事簽字並加蓋董事會印章的董事會決議；
- 2、獨立董事相關獨立意見。

特此公告。

廈門港務發展股份有限公司董事會

2017 年 1 月 24 日