

石家庄科林电气股份有限公司 关于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。

石家庄科林电气股份有限公司（以下简称“公司”）于2021年4月15日召开了第四届董事会第四次会议，审议通过了《关于开展商品期货套期保值的议案》，同意公司在保证正常生产经营的前提下，使用自有资金不超过人民币2,000万元开展期货套期保值业务。现将有关情况公告如下：

一、开展期货套期保值业务的目的

鉴于铜材等主要原材料占公司产品成本比重较大，采购价格受市场价波动影响明显，为降低原材料商品价格波动对生产经营的不利影响，综合考虑公司原材料采购规模及套期保值业务的预期成效等因素，在保证正常生产经营的前提下，公司决定使用自有资金不超过人民币2,000万元开展期货套期保值业务。利用期货的套期保值功能进行风险控制，以降低公司经营风险，保证产品成本的相对稳定。

二、开展期货套期保值业务的基本情况

（一）套期保值交易品种

公司拟开展的套期保值业务的品种只限于与生产经营相关的大宗原材料，包括但不限于铜等。

（二）预计投入资金额度及业务期间

公司拟开展期货套期保值业务的保证金最高余额不超过人民币2,000万元，使用期限自本次董事会审议通过之日起不超过12个月，在前述额度及决议有效期内可以循环滚动使用。

（三）资金来源

公司的自有资金。

（三）会计处理相关说明

公司开展铜等产品期货套期保值业务，将严格按照中华人民共和国财政部发布的《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-套期会计》、《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。

三、套期保值业务的风险分析及应对措施

公司仅开展与生产经营相关的大宗原材料套期保值业务，不进行投机交易，严格控制资金规模，但进行套期保值交易仍存在一定的风险，公司将积极采取相应措施控制风险，具体如下：

（一）基差波动风险

期货价格变动较大，期现价差波动也会很大，基差的不利波动会造成资金损失。公司将套期保值业务规模与公司的生产经营相匹配，套保周期与现货库存周期相对应，制定完备的交易预案，加强行情分析和基差规律分析，设置合理的止损，以最大程度对冲价格波动风险。

（二）资金风险

由于期货市场采取严格的保证金制度和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金浮亏风险，公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，控制资金规模，在制定交易预案的同时做好资金测算，以确保资金充裕无虞。过程中将合理计划和使用保证金，合理调度资金以规避资金风险。

（三）流动性风险

如果合约活跃度较低，导致套期保值持仓无法成交或无法在合适价位成交，可能会造成实际交易结果与方案设计出现较大偏差，从而产生交易损失。公司将配置专职人员重点关注期货交易情况、聘请期货公司顾问，科学规划和使用资金，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

（四）内部控制风险

期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善或人为的操作失误所造成的风险。公司制定了《商品期货套期保值管理制度》，通过加强内控和专业素养提高，落实风险防范措施，提高套保业务管理水平。

公司严格遵守商品期货交易所相关规定，积极配合交易所及期货公司相关部

门的风险管理工作。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。

四、独立董事意见

经过认真审核，我们认为：公司开展生产经营相关原材料的期货套期保值业务是为了规避大宗原材料价格波动风险，保持毛利率稳定，符合公司利益，不存在损害公司和全体股东利益的情形。公司已制定了《商品期货套期保值管理制度》，建立健全了套期保值业务的组织机构、工作机制、业务流程及风险控制措施，形成了较为完整的风险管理体系。

因此我们同意公司开展与生产经营相关原材料的期货套期保值业务。

特此公告

石家庄科林电气股份有限公司董事会

二〇二一年四月十六日