

中亿丰罗普斯金铝业股份有限公司

关于公司及子公司开展铝期货套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

中亿丰罗普斯金铝业股份有限公司（以下简称“公司”）第五届董事会第十九次会议审议通过了《关于公司及子公司开展铝期货套期保值业务的议案》，根据公司业务发展的需要，公司及子公司需开展铝期货套期保值业务，现将相关情况公告如下：

一、公司及子公司开展铝期货套期保值业务的目的

公司和子公司苏州铭恒金属科技有限公司（以下简称“铭恒金属”）作为铝合金型材及铝合金铸棒的生产商，生产经营需要使用大量的铝原材料。由于原铝市场价格波动较大，且公司及子公司部分客户在与公司签订销售合同过程中要求锁定原铝价格，以锁定其成本，因此，为避免铝价波动而造成损失，公司及子公司拟利用境内期货市场进行风险控制。

二、期货套期保值业务的开展

由公司董事会授权总经理组织建立公司期货领导小组，作为管理公司及子公司期货套期保值业务的决策机构，并按照公司已建立的《期货交易管理制度》相关规定及流程进行操作。

三、预计开展的期货套期保值业务情况

1、套期保值交易品种

公司及子公司拟开展的期货套期保值业务仅限于境内期货交易所铝期货交易合约。

2、预计投入交易金额

预计 2021 年 5 月 1 日至 2022 年 4 月 30 日内，公司及子公司套期保值累计投入保证金额在 1,000 万元人民币范围之内。其中，公司可投入保证金的设定额度为 500 万元、子公司铭恒金属可投入保证金的设定额度为 500 万元。

3、资金来源

公司将利用自有资金进行铝期货套期保值业务。

四、期货套期保值业务的风险分析

1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成期货交易上的损失。

2、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造成的风险。

3、客户违约风险：在产品交付周期内，由于铝价格的大幅波动，可能产生客户主动违约而造成公司期货交易上的损失。

4、技术风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险。

五、公司拟采取的风险控制措施

1、将套期保值业务与公司经营业务相匹配，最大程度对冲价格波动风险。公司期货套期保值业务只限于在境内期货交易、且与公司经营业务所需的材料相同的商品期货品种。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。公司及子公司在 2021 年 5 月 1 日至 2022 年 4 月 30 日内，期货套期保值累计投入保证金额不超过 1,000 万元，如拟投入超过 1,000 万元或超过各公司可投入设定额度，则须上报公司董事会，根据公司章程及有关内控制度规定，由公司董事会或股东大会进行审批授权后，方可进行操作。

3、公司将严格按照相关内控制度安排和使用专业人员，建立严格的授权和岗位牵制制度，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。

4、设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展。当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。

特此公告。

中亿丰罗普斯金铝业股份有限公司

董 事 会

2021 年 4 月 27 日