

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司 关于开展铝锭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的内容真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司（以下简称“公司”）第七届董事会第八次会议审议通过了《关于开展铝锭套期保值业务的议案》，同意公司开展铝锭套期保值业务，现将相关情况公告如下：

一、交易背景及交易品种

公司目前年度用铝量30万吨左右，由于采购成本数额较大，有必要主动采取措施，积极降低对原材料铝锭的采购风险，保证日常生产的平稳、有序进行，计划开展铝锭套期保值业务。

公司开展期货套期保值业务，仅限于本公司生产经营所需原材料铝锭的期货交易合约。

二、套期保值的目的

开展商品期货交易，可以充分利用期货市场的套期保值功能，规避由于铝锭价格的不规则波动所带来的风险，保证产品成本的相对稳定，降低对公司正常经营的影响。

三、拟投入资金及业务期间

公司及下属公司在铝锭期货套期保值业务中的投入的资金（保证金）总额合计不超过人民币10,000万元，每家公司的期货交易量不得超过各自实际铝锭生产用量的50%，业务期间为本议案通过之日起至2021年度股东大会召开之日止，授权公司总经理具体负责此项业务。

四、套期保值的风险分析

套期保值操作可以熨平铝锭价格波动对公司的影响，但同时也会存在一定风险：

- 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，造成投资损失。
- 2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金风

险。

3、流动性风险：可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

4、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风险。

5、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生产经营相匹配，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所交易的铝锭商品期货。期货持仓量不超过套期保值的现货需求量的50%，持仓时间与现货保值所需的计价期相匹配。

2、公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，不使用募集资金直接或间接进行套期保值，同时加强资金管理的内部控制，严格控制董事会批准的最高不超过10,000万元的保证金额度。

3、合理选择期货保值月份：公司将重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

4、设立专门的风险控制岗位：公司将严格按照《境内期货套期保值内部控制制度》等规定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。同时建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序。

5、设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统：公司将设立系统，保证交易系统的正常运行，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。

6、建立汇报和内审机制：子公司的交易计划应事先向母公司相关业务部门报备，母公司业务部门在发现交易计划超出董事会授权范围时应及时通知子公司暂停执行，并同时向公司总经理汇报，由总经理决定是否提请召开董事会审批新的授权。公司审计部门至少每季度应审查一次公司套期保值业务的开展情况，并向公司审计委员会及独立董事汇报审查结果。

六、可行性分析

期货市场是公司实施经营计划的一个渠道、一种工具，对期货工具的使用可以便利公司的生产经营、化解公司所面临的价格风险，从而可以更好的帮助公司达成经营目标，公司认为通过公司设立专门的风险控制岗位，严格按照相关法律法规及

公司《境内期货套期保值内部控制制度》等规定执行，不会损害中小股东的利益。

七、独立董事独立意见

经核查，公司及子公司以自有资金开展期货套期保值业务相关审批程序符合国家相关法律、法规及公司《期货套期保值管理制度》的有关规定，能够有效进行内部控制和管理，落实风险防控措施；在保证正常生产经营的前提下开展套期保值业务，有利于规避市场风险，对冲原材料价格对公司生产经营的影响，实现公司长期稳健发展，我们同意开展期铝锭套期保值业务。

八、备查文件

- 1、公司第七届董事会第八次会议决议；
 - 2、公司独立董事关于公司累计和当期对外担保等事项的独立意见。
- 特此公告。

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司

董 事 会

2021年4月30日