

## 重庆顺博铝合金股份有限公司 关于开展商品期货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、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

### 重要内容提示：

- 1、投资种类：限于与公司生产经营相关的铝等商品期货品种。
- 2、投资金额：最高保证金额度不超过 6,000 万元，有效期内可循环滚动使用。
- 3、特别风险提示：期货市场波动幅度较大，期货套期保值交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生相关风险。请投资者关注本公告中关于投资风险的相关描述。

### 一、投资情况概述

1、投资目的：公司主营业务是铝合金锭的生产和销售，主要原材料为废铝及电解铝等金属材料。近一年铝等大宗商品价格涨幅较大，如公司主要原材料价格发生大幅波动，将直接影响公司生产成本，因此公司存在原材料价格波动的经营风险，并可能因此而导致公司经营业绩的相应波动。开展公司所需原材料期货交易，可以充分利用期货市场套期保值的避险机制，降低原材料价格波动风险，锁定公司产品成本，避免原材料出现大幅波动可能带来的损失，保证产品成本的相对稳定，降低对公司正常经营的影响。

- 2、投资金额：最高保证金额度不超过 6,000 万元，有效期内可循

环滚动使用。

3、投资方式：公司结合销售和生产采购计划，经期货经纪公司建立套期保值专用账户，在上海期货交易所通过参与铝期货交易合约对铝合金锭价格进行锁定。

4、投资期限：自公司董事会审议通过之日起 12 个月内。

5、资金来源：使用公司的自有资金，不涉及募集资金。

## 二、 审议程序

公司于 2021 年 5 月 16 日召开第三届董事会第十五次会议、第三届监事会第十二会议，审议通过了《关于开展商品期货套期保值业务的议案》，独立董事发表了明确的独立意见。

## 三、 投资风险分析及风控措施

### 1、市场风险

期货行情易受基差变化影响，行情波动较大，现货市场与期货市场价格变动幅度不同，可能产生价格波动风险，造成套期保值头寸的损失。为此，公司套保业务将与其生产经营相匹配；同时，制订完备的交易预案，设置合理的止损线，严格实施止损操作。

### 2、资金风险

期货套期保值交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。为此，公司将充分考虑期货合约价格波动幅度，严控套期保值资金规模，合理设置保证金比例，时刻关注账户风险程度，在市场剧烈波动时采取及时止损或暂停交易等方式规避风险。

### 3、技术风险

因无法控制或不可预测的系统、网络、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。为此，公司将建立符合交易要求的通讯及信息服务设施系统，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减少损失。

#### 4、操作风险

在开展期货套期保值交易业务时，如发生操作人员未按规定程序报备及审批，或未准确、及时、完整地记录期货业务信息，将可能导致期货业务损失或丧失交易机会。为此，公司将完善人员配置，组建专业操作团队，健全业务处理程序，实行授权管理和岗位牵制。同时加强业务人员能力的的培训和学习，提高业务人员的综合素质。

#### 5、内部控制风险

期货套期保值交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善或人为操作失误所造成的风险。为此，公司制定了《商品期货套期保值业务管理办法》，加强内部控制，落实风险防范措施及期货套期保值业务操作流程，规范期货套期保值业务操作管理。

#### 6、信用风险

信用风险主要来自于交易对手和代理机构。来自于交易对手的信用风险一般由期货交易所及经纪公司保障及控制；经纪公司方面的信用风险，公司将在信用评估的基础上慎重选择代理机构，并对每家代理机构设定交易限额，控制在不同机构的风险量与其实力相匹配，并加强对代理机构信用情况的定期跟踪，以调整交易限额。

#### 7、法律风险

开展套期保值必须遵守国家关于套期保值的法律法规，还要遵守交易所的规则，并明确约定与代理机构之间的权利义务关系。为此，公司

将严格执行期货业务法律法规和市场规则，合规合法操作；通过严格审核与期货公司合同，明确权利和义务，防范和控制法律风险。

#### **四、 投资对公司的影响**

公司按照决策、执行、监督职能相分离的原则建立健全相关投资的审批和执行程序，确保事宜的有效开展和规范运行，确保资金安全。在符合国家法律法规，并确保不影响公司主营业务正常开展的前提下进行期货交易，不会影响公司业务的正常开展。

#### **五、 独立董事意见**

独立董事认为：公司根据自身经营特点及原材料价格波动特性，在不影响正常经营、操作合法合规的前提下，选择适当的时机进行原材料套期保值业务，不会影响公司主营业务的正常发展。公司已制定了《商品期货套期保值业务管理办法》，董事会授权公司套期保值领导小组在授权范围内负责组织实施。本次事项的审议和决策程序符合相关法律法规及制度的规定，不存在损害公司及全体股东利益的情形。因此，同意《关于开展商品期货套期保值业务的议案》。

#### **六、 中介机构意见**

经核查，保荐机构认为：公司开展商品期货套期保值业务，有助于降低原材料价格大幅波动的不利影响，更好地规避原材料价格大幅波动给公司经营带来的风险。公司已按照相关规定制定了《商品期货套期保值业务管理办法》，建立了较为完善的商品期货套期保值业务的内部控制和风险管理制度。上述事项已经公司董事会、监事会审议通过，独立董事对该项事项发表了明确同意的意见，履行了必要的审批程序，符合《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》等相关法律法规的要求。保荐机构对公司本次开展商品期货套期保值业

务的事项无异议。

## 七、 备查文件

- 1、《第三届董事会第十五次会议决议》
- 2、《独立董事关于第三届董事会第十五次会议相关事项的独立意见》
- 3、《国海证券股份有限公司关于重庆顺博铝合金股份有限公司开展商品期货套期保值业务的核查意见》

特此公告。

重庆顺博铝合金股份有限公司

董事会

2021年5月17日