

证券代码：000690

证券简称：宝新能源

公告编号：2021-053

债券代码：112483

债券简称：16 宝新 01

债券代码：112491

债券简称：16 宝新 02

广东宝丽华新能源股份有限公司

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：新股配售或者申购、证券回购、股票及存托凭证投资、债券投资、委托理财、新三板投资、衍生品交易以及深圳证券交易所认定的其他投资行为。其中，委托理财是指公司委托银行、信托、证券、基金、保险资产管理机构、金融资产投资公司、私募基金管理人等专业理财机构对其财产进行投资和管理或者购买相关理财产品；衍生品交易内容为动力煤期货套期保值业务。

2、投资金额：证券投资总额为不超过人民币 28 亿元的闲置自有资金，其中衍生品交易动力煤期货套期保值业务合约价值不超过人民币 5 亿元，保证金最高余额不超过人民币 1 亿元（该额度包含在证券投资 28 亿额度之内，额度范围内资金可滚动使用）。

3、特别风险提示：详见本公告“三、风险分析及风控措施”

广东宝丽华新能源股份有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 8 月 5 日（星期四）召开第九届董事会第三次会议，审议通过了《关于开展商品期货套期保值业务的议案》，同意在原证券投资范围基础上增加“衍生品交易”，交易内容为公司生产经营所需原材料—动力煤期货套期保值业务，由公司（含合并报表范围内子公司）具体开展实施相关业务，投资期限为自本次董事会审议通过之日起至 2021 年 12 月 31 日止。现将相关情况公告如下：

一、证券投资情况概述

（一）为充分提高资金使用效率及回报率，经第八届董事会第十三次会议审议通过，公司（含合并报表范围内子公司）2021 年度拟继续使用不超过人民币

28 亿元的闲置自有资金进行证券投资。投资范围包括新股配售或者申购、证券回购、股票及存托凭证投资、债券投资、委托理财、新三板投资以及深圳证券交易所认定的其他证券投资行为；不包含证券衍生品。投资期限为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日。

截止 2021 年 6 月 30 日，公司共持有前述“证券投资”涵义资产合计 629,255,894.69 元。有关具体明细，以公司定期报告信息为准。

(二) 根据公司经营发展需要，为充分利用期货市场的套期保值功能，有效锁定电力主业原材料的采购成本，降低动力煤价格波动对公司稳健经营的影响，公司拟在原证券投资范围基础上增加“衍生品交易”，交易内容为公司生产经营所需原材料—动力煤期货套期保值业务由公司（含合并报表范围内子公司）具体开展实施相关业务，预计期货套期保值业务合约价值不超过人民币 5 亿元，保证金最高余额不超过人民币 1 亿元（该额度包含在证券投资 28 亿额度之内，额度范围内资金可滚动使用）。投资期限为自本次董事会审议通过之日起至 2021 年 12 月 31 日止。除上述投资范围及投资期限调整外，其他事项保持不变。

综上，公司调整后的证券投资范围包括：新股配售或者申购、证券回购、股票及存托凭证投资、债券投资、委托理财、新三板投资、衍生品交易以及深圳证券交易所认定的其他投资行为。其中，委托理财是指公司委托银行、信托、证券、基金、保险资产管理机构、金融资产投资公司、私募基金管理人等专业理财机构对其财产进行投资和管理或者购买相关理财产品；衍生品交易内容为动力煤期货套期保值业务。证券投资总额为不超过人民币 28 亿元的闲置自有资金，其中衍生品交易动力煤期货套期保值业务合约价值不超过人民币 5 亿元，保证金最高余额不超过人民币 1 亿元（该额度包含在证券投资 28 亿额度之内，额度范围内资金可滚动使用）。投资期限为自公司第九届董事会第三次会议通过之日起至 2021 年 12 月 31 日止。

公司同时提请董事会授权公司（含合并报表范围内子公司）管理层在额度范围和有效期内具体实施证券投资及衍生品交易相关业务、行使相关决策权及签署相关文件。

二、审议程序

(一) 2021 年 8 月 5 日，公司第九届董事会第三次会议审议通过了《关于

开展商品期货套期保值业务的议案》，表决情况：9票同意，0票否决，0票弃权。公司独立董事已对本事项发表专项意见。

（二）根据深交所《股票上市规则》、《上市公司规范运作指引》及公司《章程》等相关规定，本次开展商品期货套期保值业务事宜在公司董事会决策权限范围内，无需提交公司股东大会审议。

（三）本次开展商品期货套期保值业务事宜不构成关联交易。

三、风险分析及风控措施

（一）人员配备及监督审查

1、公司证券投资业务由投资部运作开展。公司独立董事、监事会有权对证券投资资金使用情况进行监督与检查。

2、公司衍生品交易商品期货套期保值业务根据审批权限经董事会审议通过后，由公司（含合并报表范围内子公司）开展实施。公司设立期货套期保值领导小组，负责动力煤期货具体操作方案的审批及相关决策的制定，下设期货套期保值工作小组，配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员，作为套期保值工作的日常办事和操作机构，负责公司期货套期保值业务操作方案的编写、执行及相关业务的具体实施。公司董事会审计委员会对期货套期保值业务开展的必要性和风险控制情况具有审查权。

（二）管理制度

1、公司遵循合法、审慎、安全、有效的原则，借鉴国际较为成熟的内部控制和风险管理框架，立足公司实际情况，颁布实施了公司《内部控制管理手册》、《内部控制制度汇编》，通过《资金管理制度》，规范资金活动的筹资、投资及资金运营等业务操作，优化资金筹措，控制资金风险；通过投资管理制度，加强对公司投资项目的监管和过程控制，确保投资项目有效运营；公司对于证券投资具有较完善的内部控制体系，能有效防范投资风险；

2、公司及子公司广东宝新资产管理有限公司制订了证券投资的制度性文件，对证券投资的原则、范围、权限、内部审核流程、资金使用情况的监督、风险控制、责任部门及责任人等均作了详细规定，能有效管控证券投资各环节各流程风险；

3、根据深交所《上市公司规范运作指引（2020修订）》、公司《章程》及商

品交易所期货交易规则等有关规定，公司制定了《广东宝丽华新能源股份有限公司商品期货套期保值业务管理制度》，对开展期货套期保值业务的目的、组织机构、审批及权限、业务流程、风险控制、报告制度、信息披露、档案管理、保密制度、应急处理、合规检查及责任追究等方面做出了明确规定，有利于加强期货套期保值业务的风险管理和控制。

（三）衍生品交易商品期货套期保值业务风险分析及风控措施

1、商品期货套期保值业务风险

①套保头寸价格变动风险：行情变动较大时，可能产生价格不利波动，造成投资损失。

②资金风险：行情急剧变化时，可能造成资金流动性风险，可能因为来不及补充保证金而被强制平仓带来的实际损失。

③内部控制风险：可能会产生由于内部控制体系不完善造成的风险。

④技术风险：可能存在着因系统崩溃、程序错误、信息风险、通信失效等可能导致交易无法成交的风险。

⑤道德风险：可能由相关人员道德问题引发道德风险。

2、风控措施

①公司开展的套期保值业务与其生产经营相匹配。开展套保业务前，公司须将包括但不限于建仓品种、总套保量、拟投入的总保证金、风险控制要求、应对措施等要素形成套保计划；在权力机构授权范围内谨慎实施套保方案。

②套保方案的拟定将充分考虑期货合约价格波动幅度，设置合理的保证金比例和止盈止损点位等；持仓过程中持续关注期货账户风险程度，做好追加保证金准备。公司留存一定比例的风险备用金用于保证当期套保过程中出现亏损时及时补充保证金，避免因期货账户中资金无法满足和维持套保头寸时被强制平仓；公司财务部负责对套保过程中的资金风险进行评估和监控，加强内控管理和资金管理，及时识别和防范交易中出现的资金风险。

③对公司商品期货套期保值业务相关风险控制制度和程序的评价和适时监督，不定期对套保业务进行内部检查；公司董事会定期对现行的商品期货套期保值风险管理程序和程序进行评价，确保其与公司的资本实力和管理水平一致；公司也将根据实际需要相关的管理制度进行审查和修订，确保制度能够适应实际运作和规范内部控制的需要。

④合理设置符合交易需求的通讯及信息服务设施，以期最大程度保障交易的正常开展。

⑤合理设置套保业务的组织机构，建立岗位责任制，明确各相关部门和岗位的职责权限；严格要求从事套保业务的人员具备良好的职业道德和较高的职业技能；规范其自身行为，增强遵纪守法的意识。

四、对公司的影响

（一）对公司生产经营的影响

有利于进一步贯彻实施公司“产融结合、双轮驱动”发展战略，充分利用期货市场套期保值功能，防范大宗原材料价格波动风险，有效锁定公司电力主营业务的原材料采购成本，进一步提升公司整体抵御风险能力。

（二）对公司财务核算的影响

公司将严格按照《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》及《企业会计准则第 37号—金融工具列报》等会计政策的规定进行对应的财务核算和处理。

五、独立董事意见

“根据中国证监会《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》、深交所《上市公司规范运作指引》、《股票上市规则》及公司《章程》有关规定，我们作为公司独立董事，对提交公司第九届董事会第三次会议审议的《关于开展商品期货套期保值业务的议案》进行了审阅，并查阅相关资料和问询有关情况，经过充分讨论后对本次事项发表独立意见如下：

1、公司在保障正常运营和资金安全的基础上，开展商品期货套期保值业务事宜的决策审批程序符合有关法律法规和规范性文件，合法合规。

2、公司（含合并报表范围内子公司）拟结合生产原材料的采购情况，开展动力煤期货套期保值业务，符合公司的生产经营需要，有利于降低原材料价格波动对公司生产经营成本的影响，提升公司整体抵御风险能力。

3、公司制定了《商品期货套期保值业务管理制度》，对开展期货套期保值业务的目的、组织机构、审批及权限、业务流程、风险控制、报告制度、信息披露、档案管理、保密制度、应急处理、合规检查及责任追究等方面做出了明确规定，

有利于加强期货套期保值业务的风险管理和控制。

4、公司本次开展商品期货套期保值业务事宜符合公司和全体股东的利益，不存在损害公司及全体股东，特别是中小股东利益的情形。

我们同意调整公司开展商品期货套期保值业务事宜。”

六、要求披露的其他内容

公司将持续跟踪证券投资与衍生品交易的执行进展和投资安全状况，并按照相关规定及时履行信息披露义务。

七、备查文件

（一）经与会董事签字并加盖董事会印章的《广东宝丽华新能源股份有限公司第九届董事会第三次会议决议》；

（二）《广东宝丽华新能源股份有限公司独立董事关于开展商品期货套期保值业务的独立意见》；

（三）《广东宝丽华新能源股份有限公司关于开展商品期货套期保值业务的可行性分析报告》；

（四）《广东宝丽华新能源股份有限公司商品期货套期保值业务管理制度》。

特此公告。

广东宝丽华新能源股份有限公司

董 事 会

二〇二一年八月六日