

## 江西九丰能源股份有限公司

### 关于开展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。

江西九丰能源股份有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 8 月 20 日召开第二届董事会第十次会议，审议通过了《关于开展套期保值业务的议案》。为提高公司规范运作水平，在公司套期保值业务过程中有效防范和控制风险，确保公司董事、高级管理人员及相关工作人员在套期保值的业务中全面、认真履行职责，根据《公司法》、《证券法》、等法律、规范性文件及《公司章程》、《期货套期保值业务内部控制制度》等制度规定，公司拟开展套期保值业务。现将具体情况公告如下：

#### 一、套期保值的目的

公司开展套期保值业务的目的是对大宗商品交易价格、进出口业务结算外汇进行套期保值，通过价格的风险管理，在期货市场上与实货市场的反向操作，以期减轻未来采购实货产品时采购价格上涨，以及公司持有的实货产品未来销售时销售价格下跌对经营业绩造成的不利影响，降低公司采购成本风险、贸易风险和汇率风险，提高资金管理效益，维护公司及全体股东的利益。

#### 二、套期保值业务概述

##### 1、商品套期保值

预计投入保证金额度 10,000 万美元（折合人民币不超过 64,854 万元，美元汇率按 8 月 10 日人民银行美元中间价折算，具体以实际交易时汇率确定）。

套期保值业务只限于与公司日常经营相关的商品，额度可循环使用，授权套期保值业务人员根据实际情况开展，期限自 2021 年 7 月 1 日起至 2022 年 6 月

30日。

部分套期保值业务的平台为中国工商银行股份有限公司和 ISDA 协议规范下的场外衍生产品市场及其他受监管的交易平台和金融机构，公司在交易过程中将使用银行的专项授信额度，不需要缴纳任何保证金。本项套期保值业务不会对公司的资金使用计划产生不利影响。

## **2、外汇套期保值**

公司及子公司拟使用自有资金开展外汇套期保值业务，单日最高余额不超过10亿元人民币的交易额度，单笔业务交易期限不超过3年，授权期限自2021年7月1日起至2022年6月30日，上述额度在有效期内可循环使用。

## **3、审议程序**

本事项经公司第二届董事会第十次会议审议通过，尚需提交股东大会审议。

## **三、套期保值业务的风险分析及控制措施**

### **1、风险分析**

公司进行套期保值时遵循稳健原则，不以投机为目的，主要为有效规避价格波动及汇率风险对公司带来的不利影响，但同时也会存在一定的风险：

**决策风险：**套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于不谨慎的决策机制导致套期策略失效，不能达到减轻现货市场价格的波动对公司业务经营稳定性造成的不利影响的目标。

**交易操作风险：**交易策略制定后，若交易未能完全按审批的方案执行、交易错单等，可能会导致套期保值业务无法达到预期效果。

**内部控制风险：**开展套期保值交易后，未建立有效的风险预警、止损等机制，可能会出现因内控制度不完善等原因导致持仓出现损失的风险。

**市场风险：**因国内外经济形势变化存在不可预见性，可能会造成汇率的大幅波动，套期保值业务面临一定的市场判断风险。

**资金及现金流风险：**即便在保证金交易制度下，套期保值业务仍须占用资金，不合理的资金安排将导致日常业务资金周转风险。

### **2、风险控制措施**

(1) 公司制定了《期货套期保值业务内部控制制度》，对套保业务品种、组

组织架构及职责、授权管理、实施流程、风险识别和风险管理等做出明确规定，为避免内部控制风险，公司将严格按照此制度进行套保业务。

(2) 制定了明确的交易原则，设置多层次审批决策机制。

(3) 严格审核交易按套期保值方案执行，确保各环节符合内控制度的规定。

(4) 严格控制套期保值的交易规模，并建立风险预警机制及止损机制以避免出现大额损失。

(5) 严格控制套期保值资金规模，不得影响公司正常经营；合理计划和安排使用保证金，降低追加保证金风险。

#### **四、独立董事意见**

公司独立董事认为：公司开展的套期保值业务与公司日常经营需求紧密相关，符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。公司对套期保值业务进行了严格的内部评估，建立了相应的监管机制，可有效控制交易风险。公司在保证正常经营的前提下，开展套期保值业务有利于规避价格波动及汇率风险，有利于提高公司抵御价格及汇率波动的能力，不存在损害公司和中小投资者利益的情况。

#### **五、备查文件**

(一) 第二届董事会第十次会议决议；

(二) 独立董事关于第二届董事会第十次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

江西九丰能源股份有限公司董事会

2021年8月23日