

股票代码：002085

股票简称：万丰奥威

公告编号：2022-018

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司 关于开展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：浙江万丰奥威汽轮股份有限公司（以下简称“公司”）及下属子公司拟开展铝锭、钢材料期货套期保值业务。

2、投资金额：公司及下属子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%。子公司无锡雄伟精工科技有限公司在钢材料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，期货交易量不得超过实际材料生产用量的50%。

3、特别风险提示：本投资无收益保证，在投资过程中可能存在价格波动风险、资金风险、流动性风险、内部控制风险、技术风险、政策风险，敬请投资者注意投资风险。

公司于2022年4月27日召开的第七届董事会第十八次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，同意公司及下属子公司开展铝锭、钢材料期货套期保值业务，现将相关情况公告如下：

一、套期保值业务概述

1、投资目的：公司目前原材料采购成本数额较大，有必要主动采取措施，积极降低对原材料的采购风险，保证日常生产的平稳、有序进行，计划开展铝锭、钢材料期货套期保值业务。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，规避由于铝锭和钢材料价格的波动所带来的风险，保证产品成本的相对稳定，降低对公司正常经营的影响。

2、业务规模及期限：公司及下属子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%。子公司无锡雄伟精工科技有限公司在钢材料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，期货交易量不得超过实际材料生产用量的50%。以上业务期间为本议案通过之日至2022年度股东大会召开之日止，在此期间授权公司管理层具体负责办理此项业务。

3、投资主体：为明确责任、控制风险，本公司及下属子公司浙江万丰摩轮有限公司、广东万丰摩轮有限公司、万丰铝轮（印度）私人有限公司、宁波奥威尔轮毂有限公司、威海万丰奥威汽轮有限公司、吉林万丰奥威汽轮有限公司、威海万丰镁业科技发展有限公司和重庆万丰奥威铝轮有限公司可根据各自的生产、市场情况开展铝锭套期保值业务；公司下属子公司无锡雄伟精工科技有限公司开展钢材料套期保值业务。

4、资金来源：公司开展期货套期保值业务的资金来源为自有资金。

二、套期保值业务审议程序

2022年4月27日，公司召开第七届董事会第十八次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，本次投资不构成关联交易，公司独立董事发表了明确同意的独立意见，本议案尚需提交公司2021年度股东大会审议。

三、套期保值业务风险分析

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，造成投资损失。

2、资金风险：期货期权交易采取保证金和逐日盯市制度，当行情发生急剧变化时，可能造成资金流动性风险，可能存在因来不及补充保证金而被强制平仓带来的实际损失。

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：期货期权交易专业性较强，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。

5、技术风险：从交易到资金设置、风险控制，到与期货公司的联络，内部系统的稳定与期货交易的匹配等，存在着因程序错误、通信失效等可能导致交易无法成交的风险。

6、政策风险：期货市场法律法规等政策发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来风险。

四、公司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、钢材料商品期货。期货持

仓量不超过套期保值现货需求量的30%，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20,000万元的保证金额度。

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。

五、套期保值业务的可行性和对公司的影响

公司开展套期保值业务，主要是为了规避原材料价格波动给公司带来的风险，保证产品成本的相对稳定，降低对公司正常经营的影响。公司套期保值计划投入的保证金规模与自有资金、经营情况和实际需求相匹配，不会影响主营业务的正常开展，也不会对公司财务及经营状况产生重大不利影响。

公司建立了较为完善的期货套期保值业务内部控制和风险控制体系，制定了《境内期货套期保值内部控制制度》，对套期保值业务的投资额度、投资品种范围、审批权限、内部审核流程、责任部门及责任人、内部风险报告制度及风险处理程序等做出明确规定，保证套保业务顺利进行，并对风险形成有效控制。

综上，公司开展期货套期保值业务是切实可行的，符合公司及全体股东的利益。

公司将根据《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》、《企业会计准则第37号-金融工具列报》相关规定及其指南，对拟开展的套期保值业务进行相应的会计核算，反映资产负债表及损益表相关项目。

六、独立董事独立意见

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，我们同意开展铝锭、钢材期货套期保值业务，同意将该事项提交公司股东大会审议。

七、备查文件

- 1、公司第七届董事会第十八次会议决议；
- 2、独立董事关于第七届董事会第十八次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

浙江万丰奥威汽轮股份有限公司

董 事 会

2022年4月29日