

## 宜宾天原集团股份有限公司

### 关于公司及控股子公司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。

宜宾天原集团股份有限公司（简称“公司”）于2022年8月30日召开的第八届董事会第二十五次会议审议通过了《关于公司及控股子公司开展商品期货套期保值业务的议案》。同意公司及控股子公司开展商品期货套期保值业务。详细情况见下：

#### 一、公司开展套期保值的目的

1、公司及公司控股子公司从事商品期货交易，目的是充分利用期货市场的套期保值功能，规避生产经营中产品、原料价格波动风险，减少因原料价格波动造成的产品成本波动，保证产品成本的相对稳定，降低对公司的经营影响。

2、公司及公司控股子公司主要从事大宗商品的贸易业务，随着业务规模的不断扩大，贸易公司拟借助期货市场的价格发现和风险对冲功能，利用境内期货市场开展期货套期保值业务，从而更好地规避公司经营商品的价格波动所产生的风险，减少价格波动给公司经营业绩造成的影响，保证公司业务稳步发展。

#### 二、套期保值的期货品种

公司选择期货交易品种的原则是：与公司及控股子公司生产经营相关的产品和所需的原燃材料以及贸易活动范围内的产品。

#### 三、套期保值开户和管理方式

涉及上述套期保值品种的公司分别开设套期保值交易账户，但由集团公司套期保值业务机构统一管理和操作。

#### **四、投入的金额和期限**

公司及控股子公司开展期货套期保值交易的风险保证金账户资金总额不超过 10,000 万元人民币，在授权额度内循环使用。

投资期限：12 个月。

#### **五、套期保值业务的可行性分析**

公司开展商品期货套期保值业务，是以规避公司经营过程中所涉及的原料、产品及贸易商品价格波动给公司带来的经营风险，降低产品价格波动对公司的影响为目的，不进行投机和套利交易。公司已建立了较为完善的期货套期保值内部控制制度，具有与开展套期保值业务交易保证金相匹配的自有资金，公司将严格按照《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》和《期货套期保值内部控制制度》等有关规定的要求，落实风险防范措施，审慎操作。

因此，公司开展商品期货套期保值业务是切实可行的，有利于公司的生产经营。

#### **六、套期保值的风险分析**

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：期货交易采取保证金和每日结算制度，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。

#### **七、公司拟采取的风险控制措施**

1、将套期保值业务与公司及控股子公司生产经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险：公司及控股子公司期货套期保值业务只限于

在境内期货交易所交易的期货。期货持仓量不超过套期保值的现货需求量，持仓时间应与现货保值所需的计价期相匹配。

2、公司及控股子公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，不使用公司募集资金直接或间接进行套期保值。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，实行授权和岗位牵制：公司将严格按照《宜宾天原集团股份有限公司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。

#### **八、独立董事意见**

公司独立董事对公司开展期货套期保值业务进行审查，认为：公司开展期货套期保值业务是以规避公司生产经营活动中所涉及的原料、产品及贸易商品价格波动给公司带来的经营风险，降低产品价格波动对公司的影响为目的，不存在投机和套利交易。此外，公司已建立了较为完善的期货套期保值内部控制制度，能够控制风险。同意公司开展期货套期保值业务。

#### **九、授权事项**

授权公司期货领导小组按照《宜宾天原集团股份有限公司期货套期保值内部控制制度》组织实施期货套期保值业务。

特此公告

宜宾天原集团股份有限公司

董事会

二〇二二年八月三十一日