

证券代码：603629

证券简称：利通电子

公告编号：2023-015

江苏利通电子股份有限公司

关于继续开展期货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。

江苏利通电子股份有限公司（以下简称“公司”或“利通电子”）于 2022 年 1 月 21 日召开第二届董事会第十四次会议，会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，同意公司开展期货套期保值业务，占用的保证金最高额度不超过人民币 1,000 万元（不含标准仓单交割占用的保证金规模），业务期限为自本次董事会审议通过之日起一年内有效，期限内资金可循环使用。

公司开展商品期货套期保值业务已于 2023 年 1 月 21 日到期。根据期货业务相关监管法规和《江苏利通电子股份有限公司期货套期保值业务管理制度》的有关规定，结合公司日常业务需要，公司拟继续开展期货套期保值业务，以有效防范和化解部分大宗材料采购价格波动风险。公司本次拟开展的期货套期保值业务占用的保证金最高额度不超过人民币 1,000 万元（不含标准仓单交割占用的保证金规模），现将相关情况说明如下：

一、前期期货套期保值业务实施情况

1、套保业务额度及审批情况。

2022 年 1 月 21 日，公司召开第二届董事会第十四次会议，会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，为降低大宗商品价格波动对公司经营业绩的影响，同意公司开展期货套期保值业务，占用的保证金最高额度不超过人民币 1,000 万元（不含标准仓单交割占用的保证金规模），业务期限为自本次董事会审议通过之日起一年内有效，期限内资金可循环使用，到期前采用差额平仓或实物交割的方式。

2、套保业务实施情况。公司根据实际生产经营对钢材的需求规模，合理确定开展热卷期货套期保值业务的规模，严格控制期货交易的数量与资金规模，确保公司的正常生产经营，同时公司不断建立健全期货风险管理机制，加强期货业务的风险管控。公司自 2022 年 9 月开始开展热卷期货套期保值业务，截至 2022 年 12 月 31 日，公司热卷期货套期保值业务的累计开仓合约 473.87 万元，期末持仓合约余额为 248.16 万元，期间最高持仓合约金额为 248.16 万元；持仓未超过公司董事会授权额度。截止 2022 年 12 月 31 日，公司期货保证金 207.48 万元，公司期货保证金占用为 49.212 万元。授权期内公司期货合约已结束交易账面收益总额为 75,383.21 元（其中冲减存货成本 3,000 元，计入投资收益 72,383.21 元），占公司 2022 年度经审计归母净利润的 0.11%。

二、 本次拟继续开展的期货套期保值业务概述

为降低公司生产经营相关原材料现货市场价格波动带来的不可控风险，公司将规避原材料价格波动风险、稳定采购成本为目的，结合销售和生产采购计划，择机开展期货套期保值业务，实现对冲现货市场交易中存在的价格波动风险，以此达到稳定采购成本的目的，保障公司业务稳步发展。

拟期货套期保值的开展方式如下：

1、期货品种：公司拟开展的商品期货套期保值业务的品种限于公司生产经营相关的原材料品种，主要为热卷、螺纹钢、铜等。

2、投入资金规模及来源：公司开展期货套期保值业务，占用的保证金最高额度不超过人民币 1,000 万元（不含标准仓单交割占用的保证金规模），在上述额度及决议有效期内，可循环滚动使用，资金来源为本公司自有资金。

3、实施主体：江苏利通电子股份有限公司。

4、有效期：董事会根据公司制定的《江苏利通电子股份有限公司期货套期保值业务管理制度》授权董事长行使该项决策并签署相关合同文件，授权期限自本次董事会审议通过之日起一年内有效。

四、继续开展期货套期保值业务的必要性说明

公司专业从事液晶电视金属结构件制造、研发和销售业务,生产经营中需要大量的热卷、螺纹钢、铜等作为原材料。近年来,随着国际、国内经济形势、国际公共卫生事件以及市场供需关系的变化,热卷、螺纹钢、铜等的价格波动较大。原材料价格的波动直接影响公司的经营业绩,会给公司生产经营带来风险,公司的持续盈利水平也将受到挑战,企业通过金融市场套期保值以辅助正常的生产经营秩序已成为经营管理的必要手段。利用期货市场的套期保值功能,规避和减少因原材料热卷、螺纹钢、铜等价格波动引起的采购成本波动带来的经营风险,符合公司日常经营之所需。

公司将严格根据生产经营对热卷、螺纹钢、铜等的需求规模确定开展套期保值的业务规模,同时公司不断建立健全期货业务的风险管理机制,进一步加强了套期保值的风险管控。为有效规避市场风险,减少和降低大宗原材料价格大幅波动对公司主营业务的不利影响,公司拟继续利用商品期货市场开展套期保值业务。

五、期货套期保值业务的风险分析

公司开展期货套期保值交易业务主要为规避原材料价格的大幅波动对公司带来的影响,但同时也会存在一定的风险:

1、市场风险:市场发生系统性风险;期货价格与现货价格出现背离,造成交易损失。

2、流动性风险:如果合约活跃度较低,导致套期保值持仓无法成交或无法在合适价位成交,令实际交易结果与方案设计出现较大偏差,造成交易损失。

3、操作风险:套期保值专业性较强,复杂程度较高,存在操作不当或操作失败,从而带来风险。可能存在因期货交易市场价格大幅波动没有及时补充保证金而被强行平仓带来损失的风险。

4、技术风险:由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行,导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题。

5、政策风险:期货市场相关政策发生重大变化,从而导致期货市场发生剧烈变动或无法交易的风险。

公司董事会将对受托方、资金使用方等交易各方当事人的基本情况、信用情况及其交易履约能力等进行必要的尽职调查。

六、期货套期保值业务的风险控制措施

1、明确套期保值业务交易原则：套期保值业务交易以保值为原则，并结合市场情况，适时调整操作策略，提高保值效果。

2、严格控制套期保值业务的资金规模，在公司董事会批准的额度和期限内，合理计划和使用保证金，并对保证金的投入执行严格资金划转签批流程，确保期限内任一时点的套期保值交易投入保证金金额不得超过获批额度。

3、公司建立《江苏利通电子股份有限公司期货套期保值业务管理制度》，对套期保值交易的授权范围、审批程序、风险管理及信息披露做出了明确规定，能够有效规范期货套期保值交易行为，控制交易风险。同时不断加强相关工作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。

4、加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，及时合理地调整套期保值思路与方案。

七、对公司日常经营的影响

公司拟开展的期货套期保值业务仅限于生产经营相关的产品，目的是借助期货市场的价格发现、风险对冲功能，利用套期保值工具规避市场价格波动风险，保证公司经营业绩的稳定性和可持续性，不做投机性交易，不会影响公司主营业务的正常发展。

公司拟开展的期货套期保值交易品种为主要期货市场主流品种，市场透明度高，成交活跃，成交价格和当日结算单价能充分反映其公允价值。公司根据财政部《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》《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》相关规定及其指南，对期货套期保值业务的公允价值予以确定，对拟开展的商品期货套期保值业务进行相应的核算处理及披露。

八、履行的决策程序说明

（一）董事会审议情况。

1、公司于 2023 年 4 月 24 日召开第二届董事会第二十八次会议，审议通过了《关于继续开展期货套期保值业务的议案》。

2、公司独立董事同意本议案，并发表了独立意见。独立董事认为：公司已建立健全相关内控制度，通过加强内部管理，落实风险防范措施，控制衍生品投资风险；公司开展商品期货套期保值业务有助于充分发挥期货套期保值功能，降低原材料、产品等市场价格波动对公司生产经营成本及主营产品价格的影响，可以在一定程度上规避原材料价格波动风险，降低生产运营风险，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。同意公司在建立和执行规范、严格控制在主营业务原材料内开展期货套期保值业务。

（二）根据《上海证券交易所股票上市规则》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 5 号—交易与关联交易》《公司章程》及《江苏利通电子股份有限公司期货套期保值业务管理制度》的相关规定，本议案不需提交股东大会审议。根据有关规定，本次拟开展的期货业务不构成关联交易。

九、备查文件

- 1、《江苏利通电子股份有限公司第二届董事会第二十八次会议决议》；
- 2、《江苏利通电子股份有限公司独立董事关于公司第二届董事会第二十八次会议相关事项的独立意见》；
- 3、《江苏利通电子股份有限公司期货套期保值业务管理制度》；
- 4、《中信建投证券股份有限公司关于江苏利通电子股份有限公司开展期货套期保值业务的核查意见》

特此公告。

江苏利通电子股份有限公司董事会

2023 年 4 月 26 日