

沈阳萃华金银珠宝股份有限公司

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内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

沈阳萃华金银珠宝股份有限公司（以下简称“公司”）于2024年4月25日召开了第六届董事会第四次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，该议案尚需提交股东大会审议。现将有关事项公告如下：

一、套期保值的目的

为稳定公司经营，更好地规避原材料价格波动给公司经营带来的风险和不利影响，经总经理办公会讨论决定对黄金产品及锂盐产品进行套期保值，主要通过AU（T+D）延期交易工具、期货工具、向银行租入黄金、锂盐期货合约等期货套期保值工具，以有效规避黄金产品及锂盐产品价格大幅波动的风险。

二、交易品种和数量

公司将根据产品库存情况、公司预计产能及公司风险控制的要求，对公司存货期货套期保值交易的品种和数量规定如下：

1、期货套期保值品种：上海黄金交易所AU（T+D）延期交易工具、金融系统内的黄金租赁业务、锂盐期货品种。

2、预计全年期货套保最高持仓量：黄金产品期货套期保值业务保证金余额不超过人民币10亿元；锂盐产品期货套期保值业务保证金余额不超过人民币1亿元，累计不超过11亿元。

三、期货套期保值业务的开展

为便于业务开展，董事会提请股东大会授权套期保值业务小组在上述数量及金额范围内行使相关决策权。

四、投入资金及业务期间

根据公司对 2024 年黄金产品预计库存量、锂盐产品库存量及预计产能的合理预测和考虑公司的风险控制要求，公司拟针对黄金产品进行期货套期保值所需开仓保证金余额不超过人民币 10 亿元、针对锂盐产品进行期货套期保值所需开仓保证金余额不超过人民币 1 亿元，累计开仓保证金余额不超过人民币 11 亿元。所建立的套期保值标的以公司黄金产品和锂盐产品库存量及预计产能为基础，全年累计不得超过公司股东大会授权的数量和金额，授权公司套期保值业务工作小组负责实施，业务时间自 2024 年 1 月 1 日至公司 2024 年年度股东大会召开之日止。

五、期货套期保值的风险分析

公司开展期货套期保值业务不以投机为目的，主要为有效降低黄金产品、锂盐产品市场价格剧烈波动可能对公司经营带来的影响，但同时也会存在一定的风险，具体如下：

1、市场风险

理论上，各交易品种在临近交割期时期货市场价格和现货市场价格将趋于回归一致，但在极个别的非理性市场情况下，如市场发生系统性风险，期货价格与现货价格走势相背离等，会对公司的套期保值操作方案带来影响，甚至造成损失；

2、政策风险

如期货市场相关法规政策发生重大变化，可能导致市场发生剧烈波动或无法交易的风险；

3、流动性风险

期货交易采取保证金和逐日盯市制度，按照经公司审批的方案下单操作时，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，甚至面临因未能及时补足保证金而被强行平仓带来的损失；

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的风险；

5、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，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应风险。

六、公司采取的风险控制措施

1、公司严格执行有关法律法规，制定《商品期货套期保值业务管理制度》，对公司开展商品期货套期保值业务的审批权限、操作流程及风险控制等方面做出明确的规定，建立有效的监督检查、风险控制和交易止损机制，降低内部控制风险；

2、合理设置公司期货业务组织机构，建立岗位责任制，明确各相关部门和岗位的职责权限，严格在董事会批准的权限内办理公司商品期货套期保值业务。同时，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，提升相关人员的专业知识；

3、公司商品期货套期保值业务仅限于与公司经营业务相关性高的期货品种，业务规模将与公司经营业务相匹配，最大程度对冲价格波动风险。在制订交易方案的同时做好资金测算，以确保可用资金充裕；严格控制套期保值的资金规模，合理规划和使用资金，在市场剧烈波动时做到合理止损，有效规避风险；

4、公司内部审计部门定期及不定期对套期保值交易业务进行检查，监督套期保值交易业务人员执行风险管理制度和风险管理工作程序，及时防范业务中的操作风险。

七、独立董事专门会议意见

经核查，我们认为：为稳定公司经营，更好地规避原材料价格波动给公司经营带来的风险和不利影响，符合公司业务发展及日常经营需要，有利于公司长期稳健发展。公司通过开展商品期货套期保值业务来规避原材料和产品价格波动风险是合理的。相关决策程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。

公司已制定《商品期货套期保值业务管理制度》，明确了审批权限、专业管理、风险控制等内部控制程序，对公司控制商品期货套期保值风险起到了保障的作用。公司亦对商品期货套期保值业务的开展作出了明确规定，不存在损害公司和全体股东尤其是中小股东利益的情形。

经核查，我们认为本事项是合理的，同意公司开展期货套期保值业务，并同意提交公司股东大会审议。

八、备查文件

- 1、第六届董事会第四次会议决议；
- 2、独立董事专门会议 2024 年第二次会议决议。

特此公告。

沈阳萃华金银珠宝股份有限公司董事会

二零二四年四月二十九日