

# 浙江盾安人工环境股份有限公司

## 关于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内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

浙江盾安人工环境股份有限公司（以下简称“盾安环境”或“公司”）于2020年8月20日召开第七届董事会第四次会议，审议通过了《关于开展商品期货套期保值业务的议案》，同意公司在2021制冷年度（2020年9月—2021年8月）进行铜、锌、镍等商品期货套期保值业务，该议案尚需提交股东大会审议。具体事项如下：

### 一、开展套期保值业务的目的和必要性

为规避原材料价格波动带来的市场风险，降低经营风险，锁定原材料成本，公司拟开展铜、锌、镍等商品期货套期保值业务。商品期货套期保值主要是通过买入（卖出）与现货市场数量相当、交易方向相反的期货合约，以达到规避价格波动风险的目的。

### 二、预计开展的套期保值业务基本情况

#### 1、套期保值的期货品种：

仅限于与公司生产经营相关的主要原材料且为境内外期货交易所挂牌交易的铜、镍、锌商品期货交易合约。

#### 2、业务开展期间：2020年9月1日至2021年8月31日

#### 3、预计投入资金：

公司根据主要客户及公司生产经营需要拟进行铜、锌、镍等买入期货套期保值操作，同时对库存铜、锌进行卖出套期保值操作。公司根据铜、锌、镍未来价格走势并结合当前价格判断，铜、锌、镍等期货套期保值的保证金合计最高额度不超过7,300万元。其中：

（1）根据部分主要战略客户、长期客户要求及公司对客户产品需求量的测算，2021制冷年度公司预计进行6,000吨的铜买入期货套期保值操作。根据公司对未来铜价走势判断并结合当前铜价，按4.8万元/吨折算，上述套期保值合同额约28,800万元，所需保证金总额约5,760万元（其中主要战略客户指定部分保证金2,016万

元由客户提供，本公司实际承担保证金不超过 3,744 万元)。此外，为规避铜价波动对库存铜造成的风险，公司根据生产经营情况，2021 制冷年度拟对部分库存铜进行卖出套期保值操作，数量不超过 2,185 吨，根据公司对未来铜价走势的判断并结合当前铜价，按 4.8 万元/吨折算，上述套期保值合同额约 10,488 万元，所需保证金总额不超过 2,098 万元，该保证金由公司承担。

(2) 2021 制冷年度拟进行 1,500 吨的锌买入套期保值操作，根据公司对未来锌价走势判断并结合当前的锌价，按 1.75 万元/吨折算，上述套期保值合同额约 2,625 万元，所需保证金总额约 525 万元，该保证金由公司承担。此外，为规避锌价波动对库存锌造成的风险，公司根据生产经营情况，2021 制冷年度拟对部分库存锌进行卖出套期保值操作，数量不超过 1,200 吨，所需保证金总额不超过 420 万元，该保证金由公司承担。

(3) 2021 制冷年度拟进行 150 吨的镍买入套期保值操作，根据公司对未来镍价走势判断并结合当前的镍价，按 11.5 万元/吨折算，上述套期保值合同额约 1,725 万元，所需保证金总额约 345 万元，该保证金由公司承担。

#### 4、资金来源

公司自有资金。

#### 5、会计政策

公司套期保值业务的相关会计政策及核算原则按照财政部发布的《企业会计准则—金融工具确认和计量》及《企业会计准则—套期保值》相关规定执行。

### 三、期货套期保值业务的可行性分析

公司根据客户及公司生产经营需要进行铜、锌、镍商品期货套期保值，同时对库存铜、锌进行套期保值，可以控制原材料采购成本，规避经营中的原材料价格波动风险。公司已建立了较为完善的商品期货套期保值业务内部控制和 risk 管理制度，具有与拟开展的商品期货套期保值业务交易保证金相匹配的自有资金，并按照《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》等法律法规和公司《商品期货套期保值业务管理制度》的要求，落实风险防范措施，审慎操作，减少因原材料价格波动对公司经营业绩的影响。

### 四、套期保值风险分析

公司进行商品期货套期保值业务是以规避经营原材料价格波动风险为目的，不

做投机性、单纯套利性交易操作，在签订套期保值合约及开平仓时进行严格的风险控制，但期货市场仍存在一定的风险。

1、价格波动风险：由于突发不利因素造成期货价格在短期内出现大幅波动，造成公司被迫平仓产生较大损失或公司无法通过交割现货实现盈利；

2、信用风险：在产品交付周期内，由于商品期货价格大幅波动，客户主动违约而造成公司期货交易上的损失；

3、操作风险：由于期货交易专业性较强，复杂程度较高，存在因信息系统或内部控制方面的缺陷而导致意外损失的可能；

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、法律风险：因相关法律、法规发生重大变化可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。如果公司选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经营行为，也可能给公司带来损失。

## **五、套期保值内部控制措施**

1、公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，严格控制套期保值的资金规模，在市场价格剧烈波动时及时平仓以规避风险。

2、公司针对套期保值业务制定了《商品期货套期保值业务管理制度》，严格规定了该业务的操作程序，同时加强对相关执行人员的职业道德及业务培训，避免操作风险，建立异常情况报告机制，形成高效的风险处理程序。

3、根据《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》等有关规定，保证本次套期保值业务以公司或子公司的名义设立套期保值交易账户，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，不使用募集资金直接或间接进行套期保值。

## **六、独立董事意见**

1、公司商品期货套期保值业务的相关审批程序符合相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。

2、公司已就商品期货套期保值业务的行为建立了健全的组织机构、业务操作流程、审批流程及《商品期货套期保值业务管理制度》。

3、在保证正常生产经营的前提下，公司开展套期保值业务，有利于锁定公司的产品预期利润，控制经营风险，提高公司抵御价格波动的能力，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

综上，我们一致同意公司开展商品期货套期保值业务。

## 七、备查文件

- 1、浙江盾安人工环境股份有限公司第七届董事会第四次会议决议；
- 2、浙江盾安人工环境股份有限公司独立董事对相关事项发表的独立意见。

特此公告。

浙江盾安人工环境股份有限公司

董 事 会

2020年8月22日