

厦门港务发展股份有限公司关于贸易公司 2022年度开展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。

厦门港务发展股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年1月7日召开第七届董事会第十一次会议，会议审议通过了《关于厦门港务贸易有限公司2022年度在保证金一亿五千万人民币额度内开展套保业务的议案》，同意公司全资子公司厦门港务贸易有限公司（以下简称“贸易公司”）2022年度在保证金一亿五千万人民币额度内，开展商品期货套期保值业务，现将相关情况公告如下：

一、套期保值业务的目的

贸易公司开展套期保值业务的目的，是为了充分利用期货市场的套期保值功能实现期现市场对冲，以一个市场的盈利来弥补另一个市场的亏损，从而达到规避经营活动中的价格波动风险。

二、预计开展的套期保值业务概述

1、套期保值的交易市场

贸易公司仅限于在境内期货交易所进行场内交易，不进行场外和境外交易；拟进行套期保值交易的现货品种，仅限于在境内期货交易所交易的与贸易公司主营相关的大宗商品。目前贸易公司拟开展套期保值的产品主要为上海期货交易所、大连商品期货交易所、郑州商品期货交易所、广州期货交易所的公司有经营的品种。

2、期货品种

贸易公司的期货套期保值业务，仅限于公司已持有的，或正在有效履行的购销合同项下的与期货品种同类的产品，开展套期保值的产品主要为公司经营产品所对应的商品期货品种。

3、拟投入资金

贸易公司在2022年的期货保证金总额度是人民币1.5亿元，可滚动使用。若实际执行过程中，超出年度套期保值计划或保证金超过1.5亿元，应重新履行

审批程序。

4、资金来源

贸易公司将利用自有资金进行期货套期保值业务。

三、履行合法表决程序的说明

2022年1月7日,本公司第七届董事会第十一次会议以9票赞成,0票反对,0票弃权审议通过了《关于厦门港务贸易有限公司2022年度在保证金一亿五千万人民币额度内开展套保业务的议案》。该项套期保值业务不属于关联交易事项,无需履行关联交易表决程序;该议案在董事会权限范围内且以套期保值为目的的衍生品投资,不需提交公司股东大会审议。

四、开展套期保值业务的主要条款

1、业务范围:以套期保值为目的开展商品衍生品交易,根据现货需要开展钢材、白糖、塑料、纸浆等期货标准合约的交易,不进行投机;

2、交易品种:品种包括但不限于钢材、白糖、纸浆等期货标准合约的交易,不进行场外交易;

3、交易所选择:郑州商品期货交易所、大连商品期货交易所、上海期货交易所、广州期货交易所。

4、合约的交割:实物交割;

5、交易数量:根据贸易公司业务经营的情况而定;

6、合约期限:不超过12个月;

7、交易杠杆倍数:按目前价格计算为10倍左右;

8、流动性安排和清算交易原则:根据建立头寸所对应的到期日进行资金方面的准备,并按照期货交易所相应的结算价格进行购入或卖出清算;

9、支付方式及违约责任:出现违约或者交易损失,按现金汇付结算;

10、履约担保:以期货交易保证金方式担保。

五、开展套期保值业务的准备情况

1、贸易公司已制定《厦门港务贸易有限公司期货套期保值业务内部控制制度》,套期保值工作按照以上制度严格执行;

2、贸易公司建立了完善的期货套期保值业务决策、操作、监督等工作分工和控制机制。公司董事会是期货业务的最高决策机构;贸易公司期货审核小组是期货业务的日常管理机构,负责期货业务的日常管理工作,确保相关人员遵守有

关制度；负责制定、执行套期保值交易方案。

六、开展商品期货套期保值业务的风险及措施

贸易公司进行的商品期货套期保值业务遵循的是锁定商品价格风险、套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作。商品期货套期保值操作可以平滑商品价格波动对公司的影响，使公司专注于生产经营，在商品价格发生大幅波动时，仍保持一个稳定的利润水平，但同时也会存在一定风险：

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。公司拟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。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，同时加强资金管理的内部控制，不得超过公司董事会批准的保证金额度。

3、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。贸易公司将严格按照相关制度的规定进行套期保值操作，建立严格的授权和岗位制度，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。

4、技术风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险。公司将选配多条通道，降低技术风险。

七、期货公允价值分析

贸易公司衍生品交易所选择的交易所和交易品种市场透明度大，成交活跃，流动性较强，成交价格 and 结算价能充分反映衍生品的公允价值。

八、会计政策及核算原则

公司根据《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-套期保值》对金融衍生品的公允价值予以确定。

九、独立董事独立意见

公司独立董事审议了《关于厦门港务贸易有限公司 2022 年度在保证金一亿五千万万元人民币额度内开展套保业务的议案》，并发表了“同意”独立意见，独立意见有关内容参见 2022 年 1 月 8 日巨潮资讯网《厦门港务独立董事相关事项独立意见》。

十、备查文件

- 1、经与会董事签字并加盖董事会印章的董事会决议；
- 2、厦门港务独立董事相关独立意见。

特此公告。

厦门港务发展股份有限公司董事会

2022 年 1 月 7 日