

## 金圆环保股份有限公司

### 关于子公司开展期权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。

金圆环保股份有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 4 月 16 日召开第十届董事会第三次会议及第十届监事会第二次会议审议通过了《关于 2021 年度子公司开展套期保值业务的议案》，同意公司以自有资金不超过 30,000 万元保证金投资商品期货产品期货合约。

为充分利用商品期权套期保值工具以进一步降低公司铜、金、银、钯、铂、锡、镍、铅、锌等的价格波动风险，公司于 2022 年 1 月 21 日召开了第十届董事会第十一次会议及第十届监事会第九次会议审议通过了《关于子公司开展期权套期保值业务的议案》，现将有关情况公告如下：

#### 一、套期保值的目的

铜、金、银、钯、铂、锡、镍、铅、锌等是公司子公司江西新金叶实业有限公司、江西汇盈环保科技有限公司主要的库存产品及主要原材料，而其价格波动很大，给公司生产经营造成了较大影响。为减少商品库存及原材料价格波动对公司生产经营造成的不利影响，公司拟于 2022 年度开展期权套期保值业务，以有效规避价格大幅波动的风险。

#### 二、套期保值的期权品种

公司期权套期保值业务仅限于从事与公司生产经营所需原材料相关的铜、金、银、钯、铂、锡、镍、铅、锌等境内期货交易所挂牌交易的期货合约。

#### 三、期权套期保值的额度及期间

根据公司实际生产经营的商品库存及原材料需求，并秉承谨慎原则，2022 年度预计开展期权套期保值所需保证金不超过人民币 5,000 万元，上述额度内资金可以滚动使用，从事期权套期保值业务的资金来源于公司生产经营过程中积累的自有资金。

公司董事会授权公司期货工作小组按照《金圆环保股份有限公司套期保值业务管理制度》相关规定，组织实施期权套期保值业务。

**四、公司开展的期权套期保值业务满足《企业会计准则》规定的运用套期保值会计方法的相关条件。**

#### **五、开展套期保值业务的可行性分析**

公司开展相关金属的期权套期保值业务，是以规避生产经营中商品库存及原材料价格波动所带来的风险为目的，不进行投机和套利交易。实际经营过程中，相关金属作为公司的主要商品库存及原材料，受供求关系影响，其价格波动较大，为规避价格波动给公司生产经营带来的影响，公司拟在期货市场按照与现货品种相同、月份相近、方向相反、数量相当的原则进行套期保值，达到锁定原材料成本，保证公司经营业绩的稳定性和可持续性。

公司已建立了较为完善的商品套期保值业务内部控制和风险控制制度，具有与拟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《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第1号——主板上市公司规范运作》和公司《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。

因此，公司开展铜、金、银、钯、铂、锡、镍、铅、锌等期权套期保值业务是切实可行的，对公司的生产经营是有利的。

#### **六、套期保值的风险分析及风险控制措施**

公司进行的期权套期保值业务遵循的是锁定原料采购价格、产品销售价格而进行套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作，但同时也会存在一定的风险，公司审慎地制定了相关风险控制措施：

##### **1、市场风险及对策**

由于金融衍生品市场自身存在着一定的系统性风险，在进行套期保值操作时，一旦价格预测发生偏离，可能会影响套期保值业务的效果。

**风险控制措施：**公司严格执行已建立的《套期保值业务管理制度》，通过完善的内部控制决策程序形成对价格走势的合理判断；公司将套期保值业务与公司生产经营相匹配，严格控制套期保值头寸；公司交易团队严格按照审批确定后的套保方案进行操作，并由内控部进行审核和监督，确保交易风险得到有效控制。

##### **2、资金风险及对策**

交易保证金制度逐日结算制度可能会给公司带来一定的资金流动性风险，公司可能面临或出现未能及时补足交易保证金而被强行平仓造成实际损失的风险。

风险控制措施：公司将合理调度资金用于套期保值业务，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。

### 3、信用风险及对策

交易价格出现对交易对方不利的大幅度波动时，交易对方可能违反合同的相关规定，取消合同，造成公司损失。

风险控制措施：公司将建立客户的信用管理体系，在交易前按公司合同管理办法的有关规定及程序对交易对方进行资信审查，确定交易对方有能力履行相关合同。

### 4、技术风险及对策

由于无法控制或不可或缺的系统、网络、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可能会给公司造成损失。

风险控制措施：公司将设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。

## 七、独立董事发表的独立意见

公司在保证正常生产经营的前提下开展套期保值业务，将期权套期保值业务作为平抑产品价格波动的有效手段，有利于锁定公司的生产成本，控制经营风险，提高公司抵御市场波动和平抑价格震荡的能力。公司套期保值业务具体内容符合公司实际生产经营需要，通过加强内部控制，落实风险防范措施，提高经营管理水平，有利于公司的经营发展，不存在损害公司及股东、特别是中小股东利益的情形。公司董事会召集、召开董事会会议及做出决议的程序符合有关法律、法规及《公司章程》的规定。

我们一致同意《金圆环保股份有限公司关于子公司开展期权套期保值业务的议案》。

## 八、保荐机构意见

经核查，保荐机构认为：公司开展期权套期保值业务符合公司实际经营需要，可在一定程度上降低库存商品及原材料价格波动对公司正常生产经营的影响；公司已根据相关规定及实际情况制定了《套期保值业务管理制度》，相关业务管理

制度较为完备，具有相应的风险控施；公司开展期权套期保值业务已经公司第十届董事会第十一次会议及第十届监事会第九次会议审议通过，独立董事发表了明确同意的意见，符合《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第1号——主板上市公司规范运作》等相关法律法规的规定。

综上所述：保荐机构对金圆股份开展期权套期保值业务无异议。

## 九、备查文件

- 1、公司第十届董事会第十一次会次决议；
- 2、独立董事对第十届董事会第十一次会议相关事项的独立意见；
- 3、西南证券股份有限公司关于金圆环保股份有限公司开展期权套期保值业务的核查意见。

特此公告。

金圆环保股份有限公司董事会

2022年01月22日