

证券代码：600710

证券简称：苏美达

公告编号：2022-017

苏美达股份有限公司

关于公司 2022 年开展金融衍生品业务的公告

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。

苏美达股份有限公司（以下简称“公司”）于 2022 年 4 月 11 日召开的第九届董事会第十三次会议，审议通过了《关于公司 2022 年开展金融衍生品业务的议案》，现将具体情况公告如下：

一、2021 年度金融衍生品开展情况

货币类衍生品方面：2021 年，公司累计交易外汇远期达 40 亿美元，有效防范了汇率波动带来的汇兑风险。

商品类衍生品方面：2021 年，大宗商品市场价格波动剧烈，公司共叙做期货套期保值项目 125 笔，交易螺纹钢 130,840 吨、热卷 151,940 吨、铁矿石 48,500 吨、动力煤 40,000 吨、沥青 3,600 吨、铝 350 吨，有效发挥了期货套期保值的作用，稳定了经营利润。

二、2022 年计划开展金融衍生品种类及规模情况

（一）货币类金融衍生品业务

1. 计划开展品种：外汇远期、掉期、利率互换，通过资信良好的商业银行及其他机构完成交易。远期结售汇业务是指，与银行签订远期结售汇协议，约定未来结汇或售汇的外汇币种、金额、期限及汇率，到期时按照该协议订明的币种、金额、汇率办理的结售汇业务。掉期业务是指，在委托日向银行及其它机构买进即期外汇的同时又卖出同种货币的远期外汇，或者卖出即期外汇的同时又买进同种货币的远期外汇。利率互换是指两笔货币相同、债务额相同（本金相同）、期限相同的资金，作固定利率与浮动利率的调换。

2. 计划开展业务规模：根据公司业务需求，2022 年公司开展货币类金融衍生品业务在任意时点余额不超过等值 119 亿元人民币。

3. 资金占用：不占用资金，公司及控股子公司操作的远期外汇交期无需缴纳保证金。

（二）商品类金融衍生品业务

1. 计划开展业务品种：包括但不限于热卷、动力煤、沥青、螺纹钢、铁矿石、铝等。公司在期货公司开立账户，开展期货套期保值交易。期货套期保值业务是指基于套期保值的目的，建立期货合约，约定在将来某一特定的时间和地点交割一定数量和质量的商品。

2. 业务规模：公司期货套保品种根据公司及大宗商品业务及风险控制需要，螺纹钢、热卷、铁矿石、动力煤、沥青、铝期货品种的持仓上限分别为 20 万吨、15 万吨、30 万吨、50 万吨、1.5 万吨、0.25 万吨，最大时点保证金规模不超过 1.5 亿元。

3. 占用资金：开展期货业务，公司及子公司需要根据协议缴纳一定比例的保证金，该保证金为公司及子公司的自有资金。

三、开展金融衍生品的风险分析

公司开展金融衍生品交易坚持套期保值原则，不做投机性操作，以正常进出口业务为基础匹配金融衍生品的品种、规模、方向和期限，杜绝空锁。同时，金融衍生品交易也存在着一些风险：

1. 大宗商品价格剧烈变动风险：当遇到大宗商品价格剧烈变动时，期货价格与现货可能出现走势不同步的情况，二者结合无法完全对冲风险，造成损失。

2. 付款、收款预测风险：业务部门根据客户订单进行收付款金额及期间预测，在实际执行过程中，客户可能会调整订单或违约，由此可能造成公司金融衍生品业务的仓位与实际发生变动，无法实际交割，导致展期、违约等风险。

四、开展金融衍生品业务的风险控制措施

1. 公司制定了《金融产品管理办法及指引》《套期保值期货业务管理制度》规范金融衍生品交易，子公司在此基础上结合实际制定细则，对金融衍生品业务的责任部门及责任人、审批权限、操作原则、报告制度等进行明确规定，确保金融衍生品合规有效开展。

2. 公司定期对金融衍生品业务套期保值的规范性、内控机制的有效性、信息披露的真实性进行检查，确保审批流程合规、业务单据备案完整、财务账面数据与银行报价数据一致等。

3. 公司加强金融衍生品交易方面的人才建设，通过吸纳银行、期货等公司优

秀人才，开展内外部金融衍生品培训讲座，不断提高公司金融衍生品交易的专业水平，提高风险管控能力。

五、独立董事意见

公司衍生品交易均为针对实际经营中风险敞口的锁定，有利于公司规避相应原材料、商品或汇率价格波动风险，并已制定相应的切实可行的制度及预案，以及时应对交易过程中可能发生的重大突发事件，不影响公司日常经营运作和主营业务的开展，不存在损害公司股东及中小股东利益的情形，因此独立董事同意公司在授权额度范围内开展金融衍生品业务，并同意将该议案提交公司股东大会审议。

特此公告。

苏美达股份有限公司董事会

2022年4月12日