

证券代码：834815

证券简称：巨东股份

主办券商：华泰联合

## 浙江巨东股份有限公司

### 关于开展套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、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法律责任。

浙江巨东股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年4月27日召开第三届董事会第二十二次会议，审议通过了《关于开展套期保值业务的议案》。根据公司业务发展的需要，公司拟继续开展套期保值业务，现将有关情况公告如下：

#### 一、关于开展期货套期保值业务的情况

##### （一）开展期货套期保值业务的目的

公司主营业务为再生金属产品的生产和销售，铜、铝等金属具有价格波动频繁、幅度较大的特点，为规避原材料价格波动对公司生产经营所造成的不利影响以降低经营风险，公司拟继续开展铜、铝等金属期货套期保值业务。

##### （二）期货套期保值的品种和金额

1. 交易品种：仅限于从事与公司生产经营密切相关的铜、铝等金属。
2. 期货套期保值最高额度不超过5,000万元人民币，期限自2021年年度股东大会审议通过之日起至2022年年度股东大会召开之日止。
3. 资金来源：公司使用自有资金或银行授信额度进行期货套期保值业务。

##### （三）期货套期保值业务的风险分析

1. 价格波动风险：铜、铝等金属期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成期货交易的损失。
2. 资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来保证金不足的资金风险。
3. 内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内

控体系不完善造成的风险。

4. 交割风险：临近交割而持仓超出所限仓时，或因合约流动性不足而造成平仓损失。

5. 操作风险：由于错误或不完善的操作造成错单给公司带来损失。

#### **（四）风险控制措施**

1. 公司将期货套期保值业务与生产经营业务相匹配，最大程度对冲价格波动风险。

2. 公司将按照相关资金管理制度，合理调度和严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。各项套期保值业务必须严格限定在经批准的年度套期保值计划内进行，不得超范围操作。

3. 公司已制定了《套期保值业务管理制度》，公司将严格按照《套期保值业务管理制度》规定对各个环节进行控制。

4. 公司已规定进行套期保值业务只能以规避经营所需产品价格变动风险为目的，不得进行投机和套利交易。

## **二、关于开展外汇套期保值业务的情况**

### **（一）开展外汇套期保值业务的目的**

公司主营业务较多使用外币进行结算，为了规避和防范外汇市场风险，降低汇率波动对公司经营的影响，建立可控的外汇成本管理，公司拟继续开展外汇套期保值业务。

### **（二）外汇套期保值的品种和金额**

1. 交易品种：仅限于公司生产经营所使用的主要结算货币包括美元、日元。

2. 外汇套期保值最高额度不超过 20,000 万美元，期限自 2021 年年度股东大会审议通过之日起至 2022 年年度股东大会召开之日止。

3. 资金来源：公司使用自有资金或银行授信额度进行外汇套期保值业务。

### **（三）外汇套期保值业务的风险分析**

公司开展的外汇套期保值业务遵循锁定汇率风险的原则，不做投机性、套利性的交易操作，但同时外汇套期保值业务也存在一定的风险：

1. 汇率波动风险：在汇率行情变动较大的情况下，若远期结售汇确认书约定的远期结售汇汇率偏离实时汇率时，将造成汇兑损失。

2. 内部控制风险：远期结售汇交易专业性较强，复杂程度高，可能会由于内控制度不完善造成风险。

3. 客户违约风险或回款预测风险：客户应收账款发生逾期，货款无法在预测的回款期内收回，会造成远期结汇延期导致公司损失。销售部门根据客户订单和预计订单进行回款预测，实际执行过程中，客户可能调整自身订单，造成公司回款预测不准，导致远期结汇延期交割风险。

#### **（四）风险控制措施**

1. 公司已制定了《套期保值业务管理制度》，公司将严格按照其规定对各个环节进行控制，交易品种仅限于公司生产经营所使用的主要结算货币。

2. 公司将按照相关资金管理制度，合理调度和严格控制外汇套期保值的资金规模。各项套期保值业务必须严格限定在经批准的年度套期保值计划内进行，不得超范围操作。

3. 为防止远期结售汇延期交割，公司高度重视应收账款的管理，积极催收应收账款，避免出现应收账款逾期的现象。

公司开展的期货套期保值业务有利于充分发挥公司竞争优势，提高公司抵御市场波动和平抑原材料价格震荡的能力；公司开展的外汇套期保值业务是为了规避和防范外汇市场风险，降低汇率波动对公司经营的影响，建立可控的外汇成本管理。公司制定了有效的风险防控措施，开展套期保值业务是可行的，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

### **三、备查文件**

《浙江巨东股份有限公司第三届董事会第二十二次会议决议》

特此公告。

浙江巨东股份有限公司

董事会

2022年4月28日