

安徽省皖能股份有限公司

关于开展 2022 年度动力煤期货套期保值业务的公告

安徽省皖能股份有限公司（以下简称“公司”或“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责任。

重要内容提示：

- 1、公司控股子公司将开展动力煤期货套期保值业务。
- 2、预计2022年度开展期货套期保值业务累计投入保证金不超过人民币2亿元。
- 3、套期保值业务存在固有的价格波动风险、操作风险及流动性风险，公司将积极落实管控制度和风险防范措施，审慎执行套期保值操作，提醒投资者充分关注投资风险。

根据《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》等相关法律法规和《公司章程》的规定，现将相关事项公告如下：

一、动力煤期货套期保值业务审议程序

公司于2022年5月9日召开第十届董事会第十四次会议，审议通过了《关于开展2022年度动力煤期货套期保值业务的议案》，同意公司拟以控股子公司安徽电力燃料有限公司（以下简称“电燃公司”）为执行主体，以自有资金开展动力煤期货套期保值业务。电燃公司2022年度开展期货套期保值业务累计投入保证金不超过人民币2亿元。

根据《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》等相关法律法规和《公司章程》的规定，该事项不属于关联交易，经董事会审议通过后实施，无需提交公司股东大会审议。

二、动力煤期货套期保值业务情况

1、套期保值的期货品种：动力煤期货交易合约。

2、预计投入资金：根据公司产能规模，预计2022年度开展期货套期保值业务累计投入保证金不超过人民币2亿元。

3、资金来源：电燃公司将利用自有资金进行期货套期保值业务。

4、开展模式：公司为套期保值业务的管理决策主体，由公司领导层组建的决策领导小组，作为管理公司期货套期保值业务的决策机构，电燃公司为执行主体，按照《安徽省皖能股份有限公司动力煤期现结合业务管理办法》相关规定及流程进行操作。

二、动力煤期货套期保值业务的必要性与可行性分析

受宏观经济和大宗商品价格的影响，动力煤原材料价格波动频繁，直接影响了公司控股发电公司的经营业绩。公司控股发电公司生产中需要购买大量动力煤，不可避免的存在现货敞口风险，所以通过期货进行合理地套期保值是非常有必要的。

为了降低原材料及产品价格波动风险，更好地规避原材料及主要产品涨跌给公司经营带来的风险，公司拟利用境内期货市场开展期货套期保值业务。

公司从事动力煤期货套期保值投资选择的交易场所和交易品种市场公开透明，成交积极活跃，流动性较强，公司认为通过开展套期保值交易业务规避价格波动风险是切实可行的，对生产经营是有利的。

三、动力煤期货套期保值业务的风险分析

1、价格波动风险：理论上各交易品种在交割期的期货市场价格和现货市场价格会回归一致，但在极个别的非理性市场情况下，可能出现期货和现货价格在交割期仍不能回归，从而对公司的套期保值方案带来影响，甚至造成损失。

2、流动性风险：期货交易如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，市场波动时不能及时补充保证金存在被强行平仓的可能，从而造成实际损失。期货交易还可能因为市场不活跃，造成难以成交或无法交割而带来流动性风险。

3、操作风险：由于期货交易专业性强，下单指令复杂，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、信用风险：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。

5、法律风险：因相关法律制度发生变化或交易对方违反相关法律制度可能

造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

四、公司拟采取的风险控制措施

1、公司进行动力煤套期保值业务，只限于在中国境内期货交易所进行场内市场交易，不得进行境外或场外市场交易。

2、公司从事的动力煤套期保值业务品种只限于在中国境内期货交易所交易的动力煤期货及相关衍生品。

3、公司开展动力煤期货业务年度套期保值数量应与公司经营情况结合，阶段性买入套保的数量应当与发电终端实际用煤需求相匹配，阶段性卖出套保的数量应当与现货库存量相匹配。

4、公司设立风控人员，分别从风险识别、风险衡量、风险解决方案履行期货风险控制职能。套期保值审批与执行的全部流程都做好留痕与记录，以便于后期回溯查找。

5、公司设立稽核人员，对公司期货业务交易情况进行外部核查，及时向决策领导小组汇报异常情况。

6、根据《深圳证券交易所股票上市规则》等有关规定公司制定了《安徽省皖能股份有限公司动力煤期现结合业务管理办法》，对期货业务进行管理，可最大限度完善了工作流程不恰当等造成的操作风险。

7、建立了紧急处理预案，确保出现重大风险事件或遇地震、泥石流、滑坡、水灾、火灾、台风等不可抗力事件时，最大程度的挽回公司利益。

五、独立董事意见

公司独立董事认为：公司控股子公司电燃公司使用自有资金，利用期货市场开展动力煤期货套期保值业务的相关审批程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。公司已就开展动力煤期货套期保值业务建立了健全的组织机构、业务操作流程、审批流程，制定了《安徽省皖能股份有限公司动力煤期现结合业务管理办法》，通过上述措施进行风险控制。在保证正常生产经营的前提下，电燃公司使用自有资金开展期货套期保值业务，有利于控制经营风险，提高公司抵御市场波动的能力，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

安徽省皖能股份有限公司董事会

二〇二二年五月十日