

证券代码：603113

证券简称：金能科技

公告编号：2022-092

债券代码：113545

债券简称：金能转债

金能科技股份有限公司

关于新增期货套期保值额度及品种的公告

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。

金能科技股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年7月26日召开了第四届董事会第十五次会议，审议通过了《关于新增期货套期保值额度及品种的议案》，审议通过公司新增期货套期保值额度1亿元，新增品种焦煤和焦炭，同意公司及下属公司开展与生产经营相关的金融衍生品业务，现将相关情况公告如下：

一、目的和必要性

随着商品期货市场对实货市场的影响进一步深化，公司遵循套期保值的原则开展期货交易，主要目的是服务于实货业务，通过期现结合套保来管理采购和销售业务中面临的部分风险敞口，最终实现稳定采购成本和保护订单销售利润的目标。

公司商品类金融衍生品交易均为针对实际经营中的利润锁定或库存套保，规避相应原材料或商品价格波动风险。

二、业务基本情况

- 1、新增套期保值额度人民币1亿元。
- 2、新增套期保值品种为焦煤和焦炭。

三、业务风险及应对措施

公司已设立专门的管理和内部控制系统，保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。针对期货保值业务的主要风险点，公司拟采取的具体应对措施如下：

1、资金风险：因期货市场价格波动过大，造成保证金不足的风险。公司套期保值业务以套期保值为目的，严格按照制定的套期保值方案执行，保值业务规模与公司经营业务相匹配，期货、现货匹配对冲价格波动风险；每个套期保值方案都要求做好资金测算，设置止损线，时时监控，避免发生保证金不足的风险。

2、基差风险：因期货与现货价格波动率不一致造成了期现价差发生变化，导致套期保值的效果出现偏离。期货投研人员将加强市场信息的跟踪，对现货的供需情况和期货的运行逻辑进行综合分析，选择合适的合约和套保比例，尽量降低基差波动造成的套期保值效果下降。

3、流动性风险：由于合约选择不合理，交易不活跃，无法按市价进行开仓或平仓的风险。公司将重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

4、操作风险：套期保值交易专业性较强，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。公司将严格按照公司相关制度，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。

5、会计风险：公司期货交易持仓的公允价值随市场价格波动可能给公司财务报表带来的影响，进而影响财务绩效。公司将遵照《企业会计准则》，合理进行会计处理工作。

6、信用风险：公司有完善的经纪公司选择程序，所选择的经纪公司运作规范、信誉良好，发生信用风险的概率较小，并且公司将根据交易规模通过在各经纪公司分仓交易，加强资金管理，降低风险。

7、技术风险：套期保值业务过程中，存在着因系统崩溃、程序错误、信息风险、通信失效等可能导致交易无法成交的风险。公司将选配多条通道，降低技术风险。

四、董事会审议情况

2022年7月26日公司召开第四届董事会第十五次会议，审议通过《关于新增期货套期保值额度及品种的议案》。公司董事会授权公司董事长或其授权人员在上述范围内签署相关法律文件，公司管理层具体实施相关事宜。

五、监事会意见

监事会认为：公司开展套期保值业务充分利用期货市场的价格发现和套期保值功能，能有效防范和化解原料和产品价格波动带来的经营风险。为防范风险，公司已加强内部控制，完善了相关制度，总体风险可控。该事项不存在损害投资者利益的情形，因此监事会同意此次《关于新增期货套期保值额度及品种的议案》。

六、独立董事意见

独立董事认为：公司根据自身经营特点及原料和产品价格波动特性，在不影响正常经营、操作合法合规的前提下，选择适当的时机进行原料和产品套期保值业务，不会影响公司主营业务的正常发展。公司已制定了《期现业务管理制度》，董事会授权公司期现业务领导小组在授权范围内负责组织实施。本次事项的审议和决策程序符合相关法律法规及制度的规定，不存在损害公司及全体股东利益的情形。因此，同意公司此次《关于新增期货套期保值额度及品种的议案》。

特此公告。

金能科技股份有限公司董事会

2022年7月26日