

证券代码：600803

证券简称：新奥股份

公告编号：临 2022-105

新奥天然气股份有限公司

关于 2023 年度煤化工产品套期保值额度预计的公告

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法律责任。

新奥天然气股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年12月9日召开了第十届董事会第五次会议，审议通过了《关于2023年度煤化工产品套期保值额度预计的议案》，具体情况如下：

一、公司开展套期保值业务的必要性

受国内宏观经济影响，甲醇、煤炭、乙二醇、聚丙烯及塑料产品市场价格波动较大，为有效规避市场风险，减少和降低甲醇、煤炭、乙二醇、聚丙烯及塑料商品价格大幅波动对公司部分主营业务产品及相关贸易产品的不利影响，公司下属子公司拟继续利用商品期货、期权开展套期保值操作，进行风险控制。

二、2022年年初至十一月末套期保值业务情况

基于国内疫情反复和外围环境波动加速的影响，2022年化工品价格波幅大，波速加剧，国内外贸易形势较为复杂。出于风险防范与资金安全的考虑，2022年年初至十一月末，公司累计开展甲醇套期保值29.7万吨；煤炭套期保值0.1万吨；乙二醇套期保值11.8万吨；聚丙烯套期保值1.7万吨；塑料套期保值0.27万吨；最大期货保证金规模约5000万元，累计交易额1.39亿元。

三、2023年套期保值计划

2022年受到疫情、俄乌战争、美联储加息等国内外政策限制，国内能源、化工品种价格变化较快，波动率较大，加之公司套期保值需求不断增加，2023年将继续在对冲交易的原则下，严格按照期货、期权风控制度开展套期保值业务，减少和降低甲醇、煤炭、乙二醇、聚丙烯及塑料等能化产品价格波动对公司经营的不利影响。具体情况如下：

1、交易品种：

郑州商品交易所交易的甲醇期货、动力煤期货；大连商品交易所交易的乙二醇

期货、聚丙烯期货、塑料期货；及与甲醇、煤炭产品对应的期权。

2、交易数量：

2023年度，甲醇期货及期权套期保值的交易数量累计不超过100万吨；煤炭期货及期权套期保值的交易数量累计不超过20万吨；乙二醇期货套期保值的交易数量累计不超过20万吨；聚丙烯期货套期保值的交易数量累计不超过20万吨；塑料期货套期保值的交易数量累计不超过20万吨。

3、保证金规模：最大交易保证金金额不超过人民币1.8亿元，累计交易保证金金额不超过人民币5亿元。

4、目的：套期保值，配合工厂生产、企业贸易，对冲市场风险。

5、交易主体：新能（天津）能源有限公司（以下简称“新能（天津）”）、新能能源有限公司、新能矿业有限公司（以下简称“新能矿业”）。其中新能矿业委托新能（天津）开展保值交易操作，新能（天津）根据自身贸易情况开展保值交易操作，全部主体累计交易数量、保证金规模、累计交易额不超过上述额度。

四、套期保值风险分析

商品期货、期权行情波动较大，受行业政策、利率、现货市场价格、公司操作等风险因素影响，公司将继续严格执行套期保值操作，利用期货、期权锁定采购及销售价格，配合工厂生产和企业贸易，不做投机性交易，风险较小而且可控。公司对可能出现的风险因素进行了审慎的预估：

1、市场风险

一是市场发生系统性风险；二是价格预测发生方向性错误；三是期货价格与现货价格走势背离等带来风险。

2、流动性风险

如果合约活跃度较低，导致套期保值持仓无法在合适的价位成交，令实际交易结果与方案设计出现较大偏差，从而带来损失。

3、技术风险

由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、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，从而带来相应风险。

4、操作风险

期货、期权交易专业性较强，复杂程度较高，存在操作不当或操作失败的可能，

从而带来相应风险。

五、公司采取的风险控制措施

1、严格按照公司制定的期货风控制度进行保值操作，按照相关岗位职责施行逐级上报制度，决策，交易，与风险监管分开，使业务开展的更加安全，高效，可控。

2、严守套期保值原则，杜绝投机交易。将套期保值业务与公司生产经营相匹配，通过期货套期保值、价格发现功能规避现货价格波动的风险，保护盈利，坚持科学规范的套保理念，不做任何形式的市场投机。

3、严格按照公告套期保值的资金规模进行业务规划，合理使用保证金，提高资金使用效率，降低资金风险。

4、牢固掌握期货交易所相关规定、制度、法规；熟练掌握相关品种交割的各个环节，积极配合交易所及期货公司等相关部门的风险管理工作。

5、注重人才培养和激励机制

继续坚持内部培养和外部引进相结合的方式储备期货、期权操作人才，通过科学合理的激励措施发现人才并留住人才，为期货、期权业务的健康发展奠定扎实的基础。

六、董事会意见

公司第十届董事会第五次会议审议通过了《关于2023年度煤化工产品套期保值额度预计的议案》，公司独立董事对此项议案发表独立意见：鉴于甲醇、煤炭和乙二醇价格变化较快，波动率较大，公司子公司开展套期保值业务，有利于减少和降低甲醇、煤炭、乙二醇、聚丙烯及塑料产品价格波动对公司经营的不利影响，本次议案的决议程序合法有效，符合《上海证券交易所股票上市规则》及《公司章程》等法律法规及公司制度的规定，不存在损害公司和股东，尤其是中小股东利益的情形，符合公司整体利益。我们同意公司子公司在董事会审议批准的范围内开展相关业务。

特此公告。

新奥天然气股份有限公司

董 事 会

2022年12月10日