

证券代码：603113

证券简称：金能科技

公告编号：2024-036

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 2024 年度继续开展期货套期保值业务的公告

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。

金能科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2024 年 4 月 26 日召开了第五届董事会第二次会议和第五届监事会第二次会议，审议通过了《关于 2024 年度继续开展期货套期保值业务的议案》，同意公司继续在大连商品交易所继续开展套期保值业务，本议案尚需提交公司 2023 年度股东大会审议。现将相关情况公告如下：

一、开展期货、期权套期保值业务的目的

焦煤、焦炭、丙烷（国内期货品种为 LPG 期货及跨境 Argus 丙烷远东指数期货）、丙烯、聚丙烯等产品系公司的主要原料和产品，其现货价格与期货价格的波动联动紧密。公司开展原材料及产品期货套期保值业务，主要是为了锁定公司原材料成本和产品销售价格，有效控制和防范由于原材料或产品价格变动带来的市场风险，降低原材料或产品价格波动对公司正常生产经营的影响。公司仅限于开展以规避生产经营中的商品价格风险为目的的期货套期保值业务，不进行投机交易。

二、开展套期保值业务的基本情况

1、套期保值交易品种

焦煤、焦炭、丙烷（国内期货品种为 LPG 期货及跨境 Argus 丙烷远东指数期货）、丙烯、聚丙烯等。

2、投入金额及业务期限

随着公司二期项目逐步投产，未来业务量将不断增加，公司根据生产经营情况，以当期现有原料产品库存数及预计采购数为测算基准确定套期保值的数量。公司决定 2024 年度继续开展期货套期保值业务同时将累计投入保证金额度增加至不超过人民币 6 亿元，公司将利用自有资金进行套期保值操作。

本次开展套期保值业务的期限为自年度股东大会审议通过之日起不超过 12 个月，在上述额度范围内，自有资金可循环使用。

3、是否满足《企业会计准则》规定的运用套期保值会计方法的相关条件的说明

公司开展期货套期保值业务的相关会计政策及核算原则将严格按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则》等相关规定执行。

三、套期保值业务的可行性分析

1、公司已制定《期现业务管理制度》，套期保值工作按照制度严格执行。

2、公司建立了完善的套期保值业务决策、操作、监督等工作分工和控制机制。公司期现业务领导小组为套期保值业务的决策机构；期现业务操作小组负责套期保值业务的交易方案执行和日常管理工作；期现业务监督小组负责对套期保值业务参与人员的具体工作进行监督。

3、公司将合理调度自有资金进行套期保值业务，严格控制资金规模，合理计划与管理公司从事套期保值业务所需的保证金及后续护盘资金。

四、套期保值业务风险的具体措施

公司将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、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。

6、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。

五、董事会审议情况

2024年4月26日公司召开第五届董事会第二次会议，审议通过《关于2024年度继续开展期货套期保值业务的议案》，同意公司使用自有资金开展套期保值业务，公司投入保证金不超过人民币6亿元进行大宗商品套期保值。期限为自年度股东大会审议通过之日起不超过12个月。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。

六、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，因此监事会同意公司开展套期保值业务。

七、备查文件

- 1、第五届董事会第二次会议决议；
- 2、第五届监事会第二次会议决议。

特此公告。

金能科技股份有限公司董事会

2024年4月26日