

证券代码：001331

证券简称：胜通能源

公告编号：2024-016

胜通能源股份有限公司 关于公司及子公司开展 2024 年度商品套期保值业务 的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要内容提示：

1、**交易目的：**胜通能源股份有限公司（以下简称“公司”）及子公司开展商品套期保值业务，目的在于防范国际能源价格波动对公司天然气采购与销售业务的不利影响。

2、**交易品种：**BRENT 原油、JCC 原油、JKM 天然气、Henry Hub 天然气、TTF 天然气等品种。

3、**交易工具：**主要包括期货、远期、掉期、期权等。

4、**交易场所：**场内/外交易

5、**交易金额：**公司及子公司在授权有效期内预计任意交易日持有的最高合约价值不超过 15,800 万美元（约合 114,394 万元人民币），在授权有效期内拟投入的交易保证金和权利金上限最高不超过 4,750 万美元（约合 34,390 万元人民币）即在期限内任一时点不超过 4,750 万美元（约合 34,390 万元人民币），可循环使用。

6、**特别风险提示：**公司及子公司开展商品套期保值业务，目的在于防范商品价格波动带来的风险，降低外部环境变化对公司经营造成的影响。但可能存在极端行情风险、资金风险、内部控制风险、技术风险、交易对手违约风险、系统性风险，公司将积极落实风险控制措施，防范相关风险。敬请投资者关注风险。

公司第二届董事会独立董事 2024 年第一次专门会议、第二届董事会第十五次会议、第二届监事会第十二次会议审议通过了《关于公司及子公司开展 2024

年度商品套期保值业务的议案》，同意公司及子公司开展商品套期保值业务。本次事项不涉及关联交易。本次事项尚需提交公司股东大会审议。

一、投资情况概述

1、交易目的：公司及子公司开展商品套期保值业务，目的在于防范国际能源价格波动对公司天然气采购与销售业务的不利影响，降低外部环境变化对公司经营造成的影响。公司及子公司开展商品套期保值业务，将公司商品销售价格、原材料采购成本和风险控制在适度范围内，可以降低市场价格波动风险，实现公司稳健经营的目标。本次投资不会影响公司主营业务的发展，资金使用安排合理。

2、交易金额：在授权有效期内预计任意交易日持有的最高合约价值不超过15,800万美元（约合114,394万元人民币），在授权有效期内拟投入的交易保证金和权利金上限最高不超过4,750万美元（约合34,390万元人民币）即在期限内任一时点不超过4,750万美元（约合34,390万元人民币）。在上述额度内，开展套期保值业务所需保证金可循环滚动使用，有效期内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）将不超过已审议额度。

3、交易方式：套期保值场内/外交易；其中套期保值业务操作主体开展场外交易将选择具有良好资信和业务实力的交易对手，开展部分结构简单、风险可控的场外交易，以实现套期保值目的。操作主体将选择国际信用评级应达到投资级及以上（标普评级、穆迪评级、惠誉评级）的交易对手进入交易对手白名单，并定期对交易对手的信用状况、履约能力跟踪评估，动态维护白名单，实现对交易对手信用风险的管理。

4、交易品种及套期保值工具：BRENT原油、JCC原油、JKM天然气、Henry Hub天然气、TTF天然气等品种；套期保值工具为期货、远期、掉期、期权等。

5、交易期限：授权有效期自公司2023年年度股东大会审议通过之日起，持仓时间不得超过12个月或实货合同规定的时间。

6、资金来源：公司自有资金，不涉及使用募集资金或银行信贷资金。

二、相关审议程序

公司第二届董事会独立董事2024年第一次专门会议、第二届董事会第十五次会议、第二届监事会第十二次会议审议通过了《关于公司及子公司开展2024年度商品套期保值业务的议案》，同意公司及子公司开展商品套期保值业务。本

次事项不涉及关联交易。本次事项尚需提交公司股东大会审议。

三、交易风险分析及风险控制措施

（一）交易风险分析

公司及子公司进行的套期保值业务遵循规避价格波动风险、稳定生产经营的原则，不以套利、投机为目的。套期保值业务能够降低市场价格波动对公司生产经营带来的影响，但同时也会存在一定的风险，具体如下：

1. 极端行情风险：当行情大幅剧烈波动时，操作主体可能无法在要求锁定的价格及时建仓或在预定的价格及时平仓，造成损失。

2. 资金风险：可能需要向交易对手提供交易保证金，若投入金额过大，可能会带来相应的资金风险。

3. 内部控制风险：衍生品交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内部控制体系不完善造成的风险。

4. 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，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题。

5. 交易对手违约风险：价格出现不利的大幅波动时，交易对手可能违反合同的相关约定，造成公司损失。

6. 系统性风险：由于政治、经济、社会、环境、技术等因素对期货交易造成的不利影响。

（二）风险控制措施

1. 操作主体应采用科学的方法，及时识别极端行情风险、资金风险、内部控制风险、技术风险、交易对手违约风险、系统性风险等，针对不同类型、不同程度的风险事项，明确处置权限及程序。将套期保值业务与公司生产经营相匹配，对冲价格波动风险。

2. 操作主体成立专门工作组，建立风险报告和交易止损机制，动态关注极端行情风险、资金风险、内部控制风险、技术风险、交易对手违约风险、系统性风险等，妥善做好仓位止损、法律纠纷案件处置、舆情应对等工作，建立定期报告制度，防止风险扩大和蔓延，使风险管理覆盖事前防范、事中监控和事后处理的各个环节。

3. 公司已制定了《套期保值业务管理制度》，对套期保值业务资质核准、预

算与审批管理、授权管理、业务流程管理、信息报告管理、保密管理、档案管理、监督检查与责任追究及风险管理与应急处置程序等作出明确规定，建立了较为全面和完善的套期保值业务内控制度。

四、交易相关会计处理

公司将根据财政部《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》《企业会计准则第 24 号——套期会计》《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》等相关规定进行会计处理。

五、独立董事专门会议意见

公司及子公司开展商品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；公司已制定《套期保值业务管理制度》，通过加强内部控制，落实风险防范措施，为公司及子公司从事套期保值业务制定了具体操作规程；公司及子公司开展商品套期保值业务，能有效的防范和化解由于商品价格波动带来的经营风险，充分利用期货市场的套期保值功能，规避商品价格大幅波动可能给其经营带来的不利影响。因此，我们同意公司及子公司开展商品套期保值业务。

六、保荐机构核查意见

经核查，保荐机构认为：本次开展商品套期保值业务事项主要目的是为降低国际能源价格波动对公司天然气采购与销售业务带来的相关经营风险，并采取了一定的风险控制。公司已根据有关法律规定的要求建立了有效的风险控制措施，符合《公司法》《深圳证券交易所股票上市规则》等相关法律法规和规范性文件的要求，符合公司利益，不存在损害公司及股东利益，尤其是中小股东利益的情形。该事项已经公司第二届董事会独立董事 2024 年第一次专门会议、第二届董事会第十五次会议及第二届监事会第十二次会议审议通过，履行了必要的审批程序，符合《公司章程》等相关规定，该事项尚需提交股东大会审议。综上所述，保荐机构对本次公司开展外汇套期保值业务事项无异议。

七、备查文件

- (一) 第二届董事会第十五次会议决议
- (二) 第二届监事会第十二次会议决议
- (三) 第二届董事会独立董事 2024 年第一次专门会议决议

（四）关于开展商品套期保值业务的可行性分析报告

（五）国元证券股份有限公司出具的《关于胜通能源股份有限公司 2024 年度商品套期保值业务的核查意见》

特此公告。

胜通能源股份有限公司

董事会

2024 年 4 月 29 日