

证券代码：603606

证券简称：东方电缆

公告编号：2023-006

宁波东方电缆股份有限公司

关于开展 2023 年度原材料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。

宁波东方电缆股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 3 月 8 日召开第六届董事会第 3 次会议，审议通过了《关于开展 2023 年度原材料期货套期保值业务的议案》，同意公司根据《上海证券交易所股票上市规则》等相关法律法规及公司《商品期货套期保值业务管理制度》的规定，在 2023 年继续开展铜和铅商品的期货套期保值业务，具体情况如下：

一、套期保值的目的和必要性

公司紧紧围绕新时代高质量发展要求，把握国家建设海洋强国、“一带一路”倡议、新基建等要重战略机遇，构建国际、国内双向开拓、当前与今后同步推进的新市场格局，在国际、国内重大市场、重点项目开拓中取得明显成效，尤其是在新能源海上风电领域和高端陆缆系统领域。铜、铅是公司海缆系统和陆缆系统产品的主要原材料，为了规避铜和铅的价格波动对公司生产经营造成的潜在风险，充分利用期货的套期保值功能，减少因原材料价格波动造成的产品

成本波动，公司拟在 2023 年仍开展铜和铅商品的套期保值业务。

二、2023 年套期保值业务的交易额度和期限

1. 公司 2023 年度预计套期保值交易计划：

期货商品类别	最高持仓量（吨）	最高保证金（万元）
铜	30000	26000
铅	20000	4000

2. 套期保值业务授权期限

从 2022 年年度股东大会审议通过之日起至 2023 年年度股东大会召开之日止。

三、套期保值风险分析

期货行情波动较大，受行业政策、利率、现货市场价格、公司操作等风险因素影响，公司将严格执行《期货套期保值业务管理制度》，利用期货锁定采购、销售价格，配合工厂生产业务，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

一是期货市场发生系统性风险；二是期货产品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、政策风险

监管机构对期货市场相关规定、政策等进行修改，导致期货市场的法律法规等政策发生重大变化，并引起市场波动或无法交易，从而带来一定的风险。

3、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。

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，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。

四、公司采取的风险控制措施

1、公司将根据市场订单情况分批投入保证金，并且用于套期保值的保证金资金规模不超过公司上一年度经审计的合并报表净资产的 10%，以避免对公司经营资金产生较大影响。

2、公司明确铜和铅商品的套期保值业务原则，公司在国家政策允许的情况下进行期货业务，只进行场内市场交易，不进行场外市场交易，只以规避生产经营所需铜和铅商品的价格风险，不接受其他任何单位的委托和代理期货业务，不得进行投机。公司将严格执行相关内部控制制度，并采取有效的风险防范措施。

3、公司合规监督部门定期或不定期对套期保值业务进行检查，监督套期保值工作的开展，控制风险。

五、套期保值业务对公司的影响

1、可以提高资金的使用效率

由于期货、期权交易采用保证金交易制度，因此，用少量的资金就可以锁定大批货物和库存，并加快资金的周转速度，节省资金成本，避免资金规模占用。

2、可有效降低铜、铅原材料价格波动带来的经营风险

开展铜、铅原材料套期保值业务可以充分在期货、期权市场和现货市场里实现价格主动管理，规避生产经营中使用的铜、铅的价格风险，减少因原材料价格波动造成的产品成本波动，从而保证产品利润更加稳定，降低对公司正常经营的影响。

六、独立董事审核意见

公司 2023 年开展原材料期货套期保值业务，有利于充分利用期货市场的套期保值功能，减少因原材料价格波动可能给公司生产经营带来的不利影响，符合公司和全体股东的利益。公司已制定《期货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，为公司从事套期保值业务制定了具体操作规程。公司开展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。因此，我们同意公司 2023 年度开展原材料期货套期保值业务，并同意提交股东大会审议。

七、备查文件

- 1、第六届董事会第 3 次会议决议；
- 2、第六届监事会第 3 次会议决议；
- 3、独立董事关于第六届董事会第 3 次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

宁波东方电缆股份有限公司董事会

二〇二三年三月十日