

## 道道全粮油股份有限公司

### 关于增加 2020 年套期保值占用期货保证金余额的公告

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

2020 年 12 月 15 日，道道全粮油股份有限公司（以下简称“公司”）第三届董事会第三次会议审议并通过《关于对前期追加的期货保证金予以确认并增加公司 2020 年套期保值占用期货保证金余额的议案》，该议案中增加的额度属于董事会决策权限之内，无需提交股东大会审议。具体内容如下：

公司作为粮油生产与销售企业，生产经营需要大量油脂、油料等生产原料，且原材料在成本中占比较大，原材料价格波动会给公司经营造成一定影响。为稳定公司经营，更好的规避原材料价格涨跌给公司经营带来的风险，公司对大豆、豆粕，菜粕，豆油，棕榈油，菜籽油进行套期保值操作。现因 2020 年度公司业务规模的扩大，及油脂、油料价格波动原因，拟增加 2020 年套期保值占用期货保证金余额，具体情况如下：

#### 一、2020 年套期保值占用期货保证金余额预计与调整情况

##### （一）2020 年年初计划

1. 计划的具体内容：公司预计在 2020 年占用期货保证金余额在人民币 5000 万元以内（不包括交割头寸而支付的全额保证金在内）。

2. 审议程序：公司第二届董事会第二十一次会议、2019 年年度股东大会审议并通过《关于公司 2020 年开展期货套期保值业务的议案》。

#### 二、2020 年套期保值交易实施情况

截止 2020 年 12 月 14 日，公司套期保值买入占用期货保证金余额为 4,742.25 万元、卖出占用期货保证金余额为 2,661.79 万元。

#### 三、本次拟增加套期保值占用期货保证金余额

1. 本次增加原因：公司业务规模不断扩大，及油脂、油料价格上行，增加了套期保值交易额度，相应增加占用期货保证金余额。

2. 本次调整的额度：公司预计在 2020 年占用期货保证金余额不超过公司最近一年经审计净资产的 10%（不包括交割头寸而支付的全额保证金在内）。

#### **四、风险分析及风险控制措施**

公司进行套期保值交易的主要目的是为降低原材料价格波动所带来的相关经营风险，但同时也存在一定的交易风险：

1、市场风险。套期保值市场本身存在一定的系统风险，同时套期保值交易需要对价格走势作出预判，一旦价格预测发生方向性错误有可能会给公司造成损失。

2、政策风险。套期保值市场的法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来的风险。

3、流动性风险。在套期保值交易中受市场流动性不足的限制，可能会使公司不能以有利的价格进出套期保值市场。

4、操作风险。套期保值交易系统相对复杂，可能存在操作不当产生的风险。

5、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。

公司针对以上风险，严格按照公司相关制度规定进行事前、事中及事后的风险控制和管理，有效防范、发现和化解风险，确保进行套期保值交易的资金相对安全。

#### **五、对公司经营的影响**

公司套期保值交易按照决策、执行、监督职能相分离的原则建立了适当的审批和执行程序，确保套期保值交易的有效开展和规范运行，确保资金安全。在符合国家法律法规，并确保不影响公司主营业务正常开展的前提下，公司进

行与年度经营计划相匹配的套期保值交易操作，不会影响公司业务的正常开展。

公司 2020 年套期保值合约累计平仓损益（收益/亏损）将计入公司当期损益，报告期末公司套期保值持仓的公允价值变动计入公司当期损益，从而对公司 2020 业绩产生影响。

特此公告。

道道全粮油股份有限公司

董事会

2020 年 12 月 16 日