

证券代码: 838537

证券简称: 中钢电商

主办券商: 中信建投

中钢银通电子商务股份有限公司 关于开展套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、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法律责任。

中钢银通电子商务股份有限公司(以下简称“公司”)于2022年4月21日召开公司第三届董事会第八次会议,审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》,决议同意公司开展套期保值业务。具体情况如下:

一、公司开展套期保值业务的目的

公司作为以经营钢材现货交易为主营业务的钢铁电商,交易品种主要包括螺纹钢、热轧卷板和线材等。为充分利用期货市场规避风险和价格发现功能,规避交易商品价格风险,结合实际情况,公司拟开展针对相关商品的套期保值业务。

二、套期保值业务概述

(一)套期保值业务适用范围:公司在国家政策允许的范围内开展期货业务,交易标的仅限于公司经营相关的主要期货品种,包括但不限于螺纹钢、热轧卷板和线材。公司进行套期保值交易,主要目的在于通过期货交易规避交易商品市场价格波动风险,不进行投机交易。

(二)套期保值业务组织机构及职责:公司设立“套期保值领导

小组”，负责管理公司套期保值业务。

（三）套期保值业务原则方针：与公司经营相关、匹配对应的保值标的、以避险为目的，不得进行投机交易。

三、拟开展套期保值业务主要条款概述

（一）资金来源：公司自有资金。

（二）合约期限：针对大宗商品的期权、远期协议等协议的期限原则上不超过一年。

（三）业务规模：公司预计在 2022 年度内，占用期货保证金总额在人民币 1 亿元以内（含 1 亿元，但不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内）。在上述资金额度内，资金可以滚动使用。

四、套期保值业务的风险分析

（一）基差风险

理论上，期货价格是市场对未来现货市场价格的预估，由于影响因素的相近，期货价格与现货价格往往表现出同升同降的关系，但影响因素并不是完全相同的，因而某些市场环境下两者的变化幅度并不完全一致，现货价格与期货价格之间就存在价差风险。

（二）资金风险

由于期货价格的波动与实际价格的波动幅度往往并不一致，基差的存在，实际市场中很少能做到完全套期保值，加上商品期货交易实行保证金交易和逐日结算制度，若遇市场价格不利变动，保证金不足的情况，可能面临被强行平仓，导致亏损。

（三）操作风险

期货作为衍生品的虚拟性和定价复杂性使得套期保值的操作较复杂，对专业性要求较高，公司在日常的套期保值交易中可能存在操作风险。

（四）技术风险

由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成的交易系统非正常运行，使交易指令延迟、中断或数据错误等问题，导致套期保值失败，造成损失的风险。

五、公司采取的风险控制措施

（一）公司将套期保值交易头寸与公司大宗商品头寸进行匹配，对冲价格波动风险。

（二）公司将合理调度公司自有资金用于套期保值业务，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。

（三）公司根据实际情况制定了《套期保值业务管理制度》，对套期保值业务的额度、品种范围、审批权限、内部审核流程、责任部门及负责人、内部风险报告及处理程序、信息披露等作出明确规定。在实际操作中严格按照《套期保值业务管理制度》的规定，同时加强相关人员的专业知识培训，提高套期保值人员的专业能力。

（四）在业务操作过程中，公司将严格遵守国家相关法律法规规定，防范法律风险，根据《套期保值业务管理制度》规定，定期对套期保值业务的规范性、内控机制的有效性、信息披露的及时性、准确性和完整性进行核查。

七、备查文件

《中钢银通电子商务股份有限公司第三届董事会第八次会议决议》。

中钢银通电子商务股份有限公司

董事会

2022年4月22日