

证券代码： 831253

证券简称： 东进农牧

主办券商： 东莞证券

## 惠州东进农牧股份有限公司

### 关于2023年度开展商品期货期权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。

惠州东进农牧股份有限公司(以下简称“公司”)于2022年12月9日召开公司第四届董事会第四次会议，审议通过了《关于2023年度开展商品期货期权套期保值业务的议案》，同意公司及所属公司2023年度在合理范围内开展商品期货期权套期保值业务。

#### 一、公司开展商品期货期权套期保值业务的背景和必要性

公司主要是从事瘦肉型猪、种猪饲养及牲猪饲料加工(产品全部内销)。为有效规避生产经营活动中因饲料原材料和生猪价格波动带来的风险，公司计划开展商品期货期权套期保值业务。

#### 二、公司拟开展商品期货期权套期保值业务概述

1、拟投资的品种：商品期货交易所挂牌交易的玉米、豆粕、生猪等产品期货、期权合约。

2、拟投入的资金：以公司原料现货用量及库存量、生猪出栏量为基础，所需保证金最高占用额不超过人民币30,000,000.00元，交易保证金占用额均使用公司自有资金。

3、拟开展商品期货期权套期保值业务的期间：自2023年1月1日起至2023年12月31日止。

#### 三、商品期货期权套期保值业务的风险分析

1、价格波动风险：商品期货期权行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成投资损失。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。

3、内部控制风险：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风险。

4、技术风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险。

#### **四、商品期货期权套期保值业务内部控制措施**

1、公司已制订《套期保值业务管理制度》，规定公司进行商品套期保值业务只能以规避生产经营中的商品价格风险为目的，不得进行投机和套利交易。同时公司设立套期保值业务小组(简称“套保小组”)，作为管理公司套期保值业务的执行机构。

2、公司将完善交易系统及设施，保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。当发生故障时，及时采取相应处理措施，并减少损失。

3、公司将按照相关资金管理制度，合理调度和严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。自2023年1月1日起至2023年12月31日止，公司各项套期保值业务必须严格限定在经批准的套期保值计划内进行，不得超范围操作。

4、公司将定期及不定期对套期保值交易业务进行检查，监督套期保值交易业务人员执行风险管理政策和风险管理工作程序，及时防范业务中的操作风险。

5、公司将严格按照相关内控制度安排和使用专业人员，建立严格的授权与岗位牵制机制，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。

6、套期保值业务的风险影响事件，本公司将及时进行公告。

## 五、备查文件

《惠州东进农牧股份有限公司第四届董事会第四次会议决议》

惠州东进农牧股份有限公司董事会

2022年 12 月 12 日