

证券代码：834815

证券简称：巨东股份

主办券商：华泰联合

## 浙江巨东股份有限公司

### 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。

浙江巨东股份有限公司（以下简称“公司”）于2023年4月26日召开第四届董事会第六次会议，审议通过了《关于开展套期保值业务的议案》。根据公司业务发展的需要，公司拟继续开展套期保值业务，现将有关情况公告如下：

#### 一、关于开展相关金属套期保值业务的情况

##### （一）开展相关金属套期保值业务的目的

公司主营业务为再生金属产品的研发、生产和销售，铜、铝等金属具有价格波动频繁、幅度较大的特点，为规避原材料价格波动对公司生产经营所造成的不利影响以降低经营风险，公司拟继续开展铜、铝等金属套期保值业务。

##### （二）相关金属套期保值的基本信息

1. 交易品种：仅限于与公司生产经营密切相关的铜、铝等金属相关的期货、期权、远期、互换等金融衍生品。

2. 套期保值最高额度不超过10,000万元人民币，上述额度内可滚动循环使用，期限自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。

3. 资金来源：公司使用自有资金或银行授信额度进行相关金属套期保值业务。

##### （三）相关金属套期保值业务的风险分析

1. 价格波动风险：铜、铝等金属价格波动频繁、幅度较大，可能产生价格波动风险，造成相关金融衍生品交易的损失。

2. 资金风险：相关金融衍生品交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来

保证金不足的资金风险。

3. 内部控制风险：相关金属套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于公司内部控制制度不完善而造成风险。

4. 交割风险：临近交割而持仓超出所限仓时，或因合约流动性不足而造成平仓损失。

5. 操作风险：由于错误或不完善的操作造成错单给公司带来损失。

#### **（四）风险控制措施**

1. 公司已制定了《套期保值业务管理制度》，公司将严格按照其规定对各个环节进行控制，交易品种仅限于与公司生产经营密切相关的铜、铝等金属。

2. 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。各项套期保值业务必须严格限定在经批准的年度套期保值计划内进行，不得超范围操作。

3. 公司将套期保值业务与生产经营业务相匹配，最大程度对冲价格波动风险。

4. 公司已规定进行套期保值业务只能以规避经营所需产品价格变动风险为目的，不得进行投机和套利交易。

## **二、关于开展外汇套期保值业务的情况**

### **（一）开展外汇套期保值业务的目的**

公司主营业务较多使用外币进行结算，为了规避和防范外汇市场风险，降低汇率波动对公司经营的影响，建立可控的外汇成本管理，公司拟继续开展外汇套期保值业务。

### **（二）外汇套期保值的基本信息**

1. 交易品种：仅限于与公司生产经营所使用的主要结算货币包括美元、日元相关的远期外汇买卖、比率远期、远期结售汇、外汇掉期、外汇期权等外汇衍生品。

2. 外汇套期保值最高额度不超过 20,000 万美元，上述额度内可滚动循环使用，期限自 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。

3. 资金来源：公司使用自有资金或银行授信额度进行外汇套期保值业务。

### （三）外汇套期保值业务的风险分析

1. 汇率波动风险：在外汇汇率走势与公司判断汇率波动方向发生大幅偏离的情况下，公司锁定汇率后支出的成本可能超过不锁定时的成本支出，从而造成公司损失。

2. 内部控制风险：外汇套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于公司内部控制制度不完善而造成风险。

3. 交易违约风险：在外汇套期保值交易对手方出现违约的情况下，公司将无法按照约定获取套期保值盈利以对冲公司实际的汇兑损失，从而造成公司损失。

### （四）风险控制措施

1. 公司已制定了《套期保值业务管理制度》，公司将严格按照其规定对各个环节进行控制，交易品种仅限于公司生产经营所使用的主要结算货币。

2. 公司将按照相关资金管理制度，合理调度和严格控制外汇套期保值的资金规模。各项套期保值业务必须严格限定在经批准的年度套期保值计划内进行，不得超范围操作。

3. 为控制汇率大幅波动风险，公司将加强对汇率的研究分析，实时关注国际国内市场环境变化，适时调整经营、业务操作策略，最大限度地避免汇兑损失。

4. 公司已规定进行外汇套期保值业务只能以规避和防范外汇市场风险为目的，不得进行投机和套利交易。

### 三、关于开展套期保值业务对公司的影响

公司开展的相关金属套期保值业务有利于充分发挥公司竞争优势，提高公司抵御市场波动和平抑原材料价格震荡的能力；公司开展的外汇套期保值业务是为了规避和防范外汇市场风险，降低汇率波动对公司经营的影响，建立可控的外汇成本管理。公司制定了有效的风险防控措施，开展套期保值业务是可行的，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

### 三、备查文件

《浙江巨东股份有限公司第四届董事会第六次会议决议》

浙江巨东股份有限公司

董事会

2023年4月27日