

证券代码：834429

证券简称：钢宝股份

主办券商：国泰君安

江苏金贸钢宝电子商务股份有限公司 关于 2024 年度开展钢铁产业链期货及衍生品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。

一、开展套期保值业务的必要性及目的

2023 年，黑色商品价格大幅波动，钢材的库存管理面临很大挑战。公司应用期货衍生品工具，开展套期保值业务，目的是规避和转移钢材等产品价格波动的风险，稳定公司生产经营。一方面，对敞口为空仓方向，在衍生品市场对钢材相关品种进行买入交易（以下简称“买入套保”），以锁定公司的采购成本，防范成本上涨风险；另一方面，对敞口为多仓方向，在衍生品市场对钢材相关品种进行卖出交易（以下简称“卖出套保”），以实现预销售或规避存货跌价风险。

二、开展期货套期保值业务概述

1、业务主要涉及品种：公司套期保值业务仅限于与公司现货经营相关的期货交易品种，包括但不限于螺纹钢、热卷、锰硅、硅铁等品种。

2、套期保值业务工具：公司使用境内期货衍生品工具进行套期保值，以降低业务风险管理成本和提高期现业务管理效率。

3、套期保值规模：公司在同一时点累计买入套保和卖出套保数量原则上螺纹/热卷不得超过 3 万吨；锰硅不得超过 9000 吨；硅铁不得超过 3000 吨。套期保值交易保证金占用资金总额不超过人民币 2,844 万元，风险金占用资金总额不超过人民币 2,844 万元。

4、资金来源：公司套期保值业务使用自有资金，但优先使用客户订单预付款。

三、审议情况

2024 年 1 月 30 日，公司第三届董事会第十八次会议审议通过《关于 2024 年度开展钢铁产业链期货及衍生品套期保值业务的议案》。

四、管理制度

为规范钢铁产业链期货及衍生品套期保值业务的决策、操作及管理程序，依据《江

苏金贸钢宝电子商务股份有限公司章程》、《江苏金贸钢宝电子商务股份有限公司对外投资管理制度》等有关规定，结合实际情况，公司制定了《江苏金贸钢宝电子商务股份有限公司钢铁产业链衍生品套保业务管理制度》，明确公司开展期货套期保值业务的组织机构及职责、业务流程、风险管理、绩效评价等相关内容。公司将根据套期保值业务的需要，适时修订该项制度。

五、套期保值业务风险分析

公司开展商品期货套期保值业务可能存在基差、政策、资金流动性、操作、技术、对手方违约等方面的风险，具体如下：

1、政策风险

期货市场政策法规发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易等风险。

2、基差风险

期货价格与现货价格走势背离所带来的期货市场、现货市场均不利的风险。

3、资金风险

在期货价格波动大时，可能产生因未及时补充保证金而被强行平仓造成实际损失的风险。

4、违约风险

场内对手交割方不具备履约能力，或场外做市商无力履约所造成的风险。

5、操作风险

期货及衍生品交易专业性较强，若专业人员配置不足、内控不完善，会产生相应风险。

6、技术风险

由于软件、硬件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，从而带来相应的风险。

六、套期保值业务风险控制措施

1、规范套期保值业务行为

公司套期保值行为在公司套期保值决策小组授权和监督下开展，严格执行公司套期保值业务流程和决策程序。

2、加强账户资金监管

依据账户风险程度，及时平衡、调拨账户可用资金，防范账户持仓风险。

3、提升业务能力

提高套期保值业务人员的专业知识和水平，深度期现融合，提升公司套期保值业务的整体水平。

4、优化交易环境

建立“快捷、安全”的软硬件交易环境，保证交易系统的正常运行。

七、备查文件目录

《江苏金贸钢宝电子商务股份有限公司第三届董事会第十八次会议决议》

江苏金贸钢宝电子商务股份有限公司

董事会

2024年1月30日