

证券代码：874320

证券简称：恒基金属

主办券商：中泰证券

广东恒基金属股份有限公司

关于预计 2024 年度商品期货套期保值业务额度的公告

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、商品期货套期保值业务概述

(一) 商品期货套期保值业务目的

大宗原材料铜、铝等是公司产品生产所需的主要原材料，其价格波动会对公司生产经营产生较大影响。公司开展铜、铝等商品期货套期保值业务，目的是充分利用期货市场的套期保值功能，通过买入（卖出）与现货市场数量相当、交易方向相反的期货合约，避免和减少因其价格波动引起的经营风险。

(二) 商品期货套期保值业务品种和数量

1、套期保值的商品期货品种：仅限于与公司生产经营相关的主要原材料，且为在期货金融机构交易的铜、铝等商品期货交易合约。公司进行商品期货套期保值业务是以套期保值、避免经营原材料价格波动风险为目的，以具体经营业务为依托，不做投机性、单纯套利性交易。

2、预计投入资金额度：公司根据公司产能规模、主要客户市场需求，拟进行铜、铝等买入期货套期保值操作，同时对库存铜、铝等进行卖出套期保值操作。公司业务开展期间的期货套期保值合约累计金额不超过人民币 1 亿元（或累计投入保证金金额不超过人民币 1 亿元），购买远期合约标的数量不超过远期合约对应期间生产经营所需的原材料采购量。

3、资金来源：公司将以自有资金支付套期保值商品期货业务相关的保证金及到期交割资金（若到期衍生品业务产生亏损）。

4、实施主体：公司及合并范围内的子公司。

- 5、合约期限：公司所开展的所有大宗原材料期货业务期限不超过 12 个月。
- 6、交易对方：具有商品期货套期保值业务经营资格的期货交易金融机构。
- 7、业务授权：公司董事会授权公司经营层在上述额度范围内具体实施上述套期保值商品期货业务相关事宜。

（三） 商品期货套期保值业务开展期间

2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。

（四） 是否构成关联交易

公司开展商品期货套期保值业务不构成关联交易。

二、 审议程序

2024 年 4 月 22 日，公司召开第一届董事会第十二次会议，审议了《关于预计 2024 年度商品期货套期保值业务额度的议案》，表决结果为：同意 9 票；反对 0 票；弃权 0 票。上述议案尚需提交 2023 年年度股东大会审议。

三、 风险分析及风控措施

1、公司进行商品期货套期保值业务是以套期保值、避免经营原材料价格波动风险为目的，不做投机性、单纯套利性交易操作，在签订套期保值商品期货合约及开平仓时进行严格的风险控制，但期货市场仍存在一定的风险：

（1）市场风险：外围市场不确定突发事件可能会发生期货价格与现货价格走势背离或市场大幅波动，而造成公司被迫平仓产生较大损失或无法通过交割现货实现盈利。

（2）信用风险：在产品交付周期内，由于商品期货价格大幅波动，客户主动违约而造成公司期货交易上的损失。

（3）操作风险：由于期货交易专业性较强，复杂程度较高，存在因信息系统或内部控制方面的缺陷而导致意外损失的可能。

（4）法律风险：因相关法律、法规发生重大变化可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。如果公司选择的期货公司在交易过程中存在违法、违规经

营行为，也可能给公司带来损失。

2、公司对商品期货套期保值业务的风险控制措施：

（1）公司严格规定了该业务的操作程序，同时加强对相关执行人员的职业道德及业务培训，避免操作风险，建立异常情况报告机制，形成高效的风险处理程序。

（2）公司将合理调度自有资金用于套期保值商品期货业务，严格控制套期保值商品期货业务的资金规模，在市场价格剧烈波动时及时平仓以规避风险。

四、 商品期货套期保值业务对公司的影响

公司开展商品期货套期保值业务不会影响公司主营业务的发展，不存在损害公司和股东利益的情形，不会对公司业务的完整性和独立性产生不利影响。

五、 备查文件目录

《广东恒基金属股份有限公司第一届董事会第十二次会议决议》。

广东恒基金属股份有限公司

董事会

2024年4月22日