

河南通达电缆股份有限公司 关于开展期货套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要提示：

1、基本情况：

（1）交易目的：河南通达电缆股份有限公司及合并报表范围内子公司（以下合并称为“公司”）经营业务相关的主要原材料，包括但不限于铝、铜、塑料、铅、锌、锡、黄金、白银、氧化铝等商品品种，原材料价格波动会给公司经营业绩及毛利造成较大的影响。为稳定公司经营业绩，更好地规避主要原材料价格波动给公司经营带来的风险，公司拟利用期货市场开展期货套期保值业务。

（2）交易品种、交易工具：经营业务相关的铝、铜、塑料、铅、锌、锡、黄金、白银、氧化铝等境内外商品交易所或银行制定的标准合约及金融衍生品。公司使用境内外期货、掉期和场外或场内期权等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）交易场所：公司期货、期权交易的场所包括合法运营的境内上海期货交易所、大连商品交易以及伦敦金属交易所（LME）等境外期货交易所；衍生品交易的场所包括合法运营的境内大型券商、银行和大型期货公司风险管理子公司以及伦敦金属交易所（LME）等。

（4）交易额度：最高保证金和权利金金额不超过人民币40,000万元（含40,000万元，不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内），在开展相关业务期限内任一交易日持有的最高合约价值不超过20亿元，交易额度在有效期内循环使用。

（5）资金来源：公司将利用自有资金、金融机构及其子公司衍生品交易授信进行套期保值操作，不涉及使用募集资金。。

（6）专业人员配备情况：为降低价格波动带来的经营风险，公司成立了期

货套期保值业务工作小组，配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员具体负责公司期货套期保值交易事务。

2、审议程序

公司于2025年10月23日召开的公司第六届董事会第九次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，此议案尚需提交公司2025年度第三次临时股东大会审议。

3、特别风险提示

公司开展的期货套期保值业务遵循稳健原则，不进行以投机为目的的期货交易，本业务无本金或收益保证，在实施过程中存在政策风险、资金风险、违约风险等，敬请投资者充分关注相关风险。

一、期货套期保值业务概况

1、期货套期保值业务开展的目的

公司经营业务相关的主要原材料，包括但不限于铝、铜、塑料、铅、锌、锡、黄金、白银、氧化铝等商品品种，原材料价格波动会给公司经营业绩及毛利造成较大的影响。为稳定公司经营业绩，更好地规避主要原材料价格波动给公司经营带来的风险，公司拟利用期货市场开展期货套期保值业务。公司的期货套期保值业务敞口基于原材料预购及产成品预售的数量、交易期限进行测算，以具体业务合同为依托，交易金额、交易期限与实际风险敞口相匹配，原则上套保比例不超过总敞口的80%。

公司开展期货套期保值业务预计与生产经营所涉及现货购销业务冲抵后，可较好的实现套期保值交易，有利于保障公司经营业绩的稳定性。

2、投资额度：最高保证金金额不超过人民币40,000万元（含40,000万元，不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内），有效期内循环使用。

3、资金来源：公司将利用自有资金、金融机构及其子公司衍生品交易授信进行套期保值操作，不涉及使用募集资金。

4、套期保值业务场所：公司期货、期权交易的场所包括合法运营的境内上海期货交易所、大连商品交易以及伦敦金属交易所（LME）等境外期货交易所；衍生品交易的场所包括合法运营的境内大型券商、银行和大型期货公司风险管理子公司以及伦敦金属交易所（LME）等。

5、期限：授权期限自公司2025年第三次临时股东大会审议通过之日起12个

月。如单笔交易的存续期限超过了授权期限，则授权期限自动顺延至该笔交易终止时止，但该笔交易额度纳入下一个审批有效期计算。

二、审议程序

公司于2025年10月23日召开的公司第六届董事会第九次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，此议案尚需提交公司2025年第三次临时股东大会审议。

三、期货套期保值业务的风险分析及风控措施

（一）分险分析

公司开展商品期货套期保值业务可能存在政策、基差、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

宏观政策及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。

7、境外及场外衍生品交易风险

因境外政治、经济和法律等变动，或因场外产品流动性缺乏、交易对手方违约等带来的风险。

（二）风险控制措施

1、规范管理制度

为规范期货及衍生品套期保值业务的决策、操作及管理程序，依据《公司章程》等有关规定，结合实际情况，公司制定了《河南通达电缆股份有限公司期货套期保值制度》，明确公司开展期货套期保值业务的组织机构及职责、业务流程和审批报告、授权管理、风险管理、绩效评价等相关内容。

2、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领导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。

3、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。

4、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。

5、优化交易环境

建立“安全、快捷”的软硬件交易环境，保证交易系统的流畅运行。公司已与相关专业机构合作，以规范程序、控制风险和提高效率。

6、完善止损机制

对于套保过程中风险敞口发生变化导致套保必要性下降，或触发套保方案中设定的止损条件，公司相关部门及时评估并向套保领导小组提交风险分析报告。

四、交易相关会计处理

公司期货套期保值业务根据《企业会计准则第22号-金融工具确认和计量》《企业会计准则第24号-套期会计》《企业会计准则第37号——金融工具列报》《企业会计准则第39号—公允价值计量》等相关规定及其指南，对套期保值业务进行相应核算和披露。

五、备查文件

- 1、公司第六届董事会第九次会议决议；
- 2、关于开展2026年度期货套期保值业务的可行性分析报告；
- 3、公司董事会审计委员会2025年第五次会议决议。

特此公告。

河南通达电缆股份有限公司董事会

2025年10月25日