

山东金麒麟股份有限公司 关于子公司投资进展的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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责任。

一、期货投资概况

原材料热轧卷板是山东金麒麟股份有限公司（以下简称“公司”）及子公司济南金麒麟刹车系统有限公司（以下简称“子公司”）产品资料成本中占比最大的物料，预计 2021 年热轧卷板采购量将继续增加。基于长期跟踪热轧卷板现货价格走势的判断，为能在现货市场的价格波动中把握节奏，降低现货采购成本及增加公司收益，公司第三届董事会第二十二次会议审议通过了《山东金麒麟股份有限公司关于 2021 年度期货交易额度授权的议案》，董事会同意授权公司使用不超过公司最近一期经审计净资产 10% 的自有资金在不影响正常经营、操作合法合规的前提下，择机进行原材料期货套期保值和期货投资，并授权公司董事长在上述资金额度范围行使决策权并负责组织实施，授权期限自董事会审议通过之日起十二个月内有效。具体内容请详见公司在上海证券交易所官方网站及指定媒体披露的《山东金麒麟股份有限公司关于 2021 年度期货交易额度授权的公告》。

二、投资进展情况

2021 年 5 月 13 日，子公司将前期建仓的期货投资合约热卷 2105 全部平仓，平仓亏损 8,725.56 万元（含 2021 年第一季度报告已确认非经常性损益之期货合约浮动盈亏损失），占公司 2020 年度经审计净利润的 53.50%。投资损失的原因为近期钢材价格波动异常剧烈超出操作人员的常规判断所致。

三、风险分析及风险控制措施

公司期货交易操作主要目的是部分对冲原材料采购价格上涨风险及增加公司收益，但同时也会存在一定的风险：

(1) 市场风险：期货市场自身存在着一定的系统性风险，同时期货交易投资需要对价格走势作出一定的预判，一旦价格预测发生方向性错误有可能会给公司造成损失。

(2) 政策风险：期货市场的法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来的风险。

(3) 流动性风险：在期货交易中受市场流动性不足的限制，可能会使公司不能以有利的价格进出期货市场。

(4) 操作风险：期货交易专业性较强，存在操作不当或操作失败，从而带来相应风险。

(5) 技术风险：由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯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，从而带来相应风险。

在公司期货交易出现大额浮亏的情况下，为减少相关风险，公司将严格遵守《期货交易管理制度》的相关规定，严格控制期货业务的资金规模，不再转入资金，并逐步减少期货投资仓位。同时加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，有效防范、发现和化解风险，确保进行期货交易的资金相对安全，不会影响公司业务的正常开展。

四、对公司经营的影响

子公司期货平仓损益将计入公司2021年度损益从而对公司2021年度的业绩产生影响。上述事项对公司财务数据的影响未经审计，具体准确的财务数据以公司正式披露的经审计后数据为准，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

山东金麒麟股份有限公司董事会

2021年5月15日