

证券代码：603685

证券简称：晨丰科技

公告编号：2022-005

债券代码：113628

债券简称：晨丰转债

浙江晨丰科技股份有限公司 关于开展期货套期保值业务的公告

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。

浙江晨丰科技股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年1月19日召开了第三届董事会2022年第一次临时会议，审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，同意公司开展期货套期保值业务，该议案无需提交公司股东大会审议。具体情况公告如下：

一、开展期货套期保值业务目的及必要性

为促进公司业务稳健开展，规避原材料价格波动给公司带来的经营风险，控制公司生产成本，公司拟开展交易品种为铝、铜、镍、PTA等原材料的期货套期保值业务，以降低原材料市场价格波动对公司正常生产经营活动的影响。

二、开展期货套期保值业务的基本情况

（一）交易品种：铝、铜、镍、PTA等。

（二）预计投入资金额度及来源：最高保证金金额不超过人民币5000万元，在有效期内可循环滚动使用。套期保值业务使用公司自有流动资金进行操作，不涉及募集资金。

（三）有效期：董事会授权期货业务领导小组根据公司制定的《期货套期保值业务管理制度》行使该项决策并签署相关合同文件，授权期限自本次董事会审议通过之日起2年内，如在此期间董事会重新对本事项作出新的决议，则授权期限至董事会重新对本事项作出新的决议之日止。

三、开展期货套期保值业务的风险分析

公司进行期货套期保值业务以对现货保值为目的，主要为有效规避原材料及

产品价格波动对公司带来的不利影响，但同时也会存在一定的风险：

（一）价格波动风险：在期货行情变动较大时，公司可能无法实现在材料锁定价格或其下方买入套保合约，造成损失。

（二）政策风险：期货市场的法律法规等相关政策发生重大变化，从而导致期货市场发生剧烈变动或无法交易的风险。

（三）流动性风险：如果合约活跃度较低，导致套期保值持仓无法在合适的价位成交，令实际交易结果与方案设计出现较大偏差，从而带来损失。

（四）操作风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，存在操作不当或操作失败的可能，从而带来相应风险。

（五）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，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题。

四、公司采取的风险控制措施

（一）公司制定了《期货套期保值业务管理制度》，明确了开展套期保值业务的组织机构及职责、业务授权及操作流程、风险管理等内容，通过严格的内部控制指导和规范执行，形成较为完整的风险控制体系。

（二）严守套期保值原则，杜绝投机交易。将套期保值业务与公司生产、经营相匹配，且只限于在国内期货交易所交易的铝、铜、镍、PTA 等期货品种，最大程度对冲价格波动风险。

（三）严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，不使用募集资金直接或间接进行套期保值。

（四）加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，及时合理调整套期保值思路与方案。

（五）严格遵守商品期货交易所相关规定，积极配合交易所及期货公司相关部门的风险管理工作。

五、开展期货套期保值业务的会计核算原则

公司根据财政部发布的《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》等相关规定和指南，对套期保值业务进行相应的会计处理。

六、独立董事意见

公司独立董事关于公司开展期货套期保值业务发表如下意见：

公司开展原材料期货套期保值业务，通过套期保值的避险机制可减少因原材料价格波动造成的产品成本波动给公司生产经营带来的不利影响，保证产品成本的相对稳定，进而维护公司正常生产经营活动，提高公司抵御市场波动和平抑价格震荡的能力。公司已制定《期货套期保值业务管理制度》，加强内部控制，落实了风险防范措施，为公司从事套期保值业务制定了具体操作规程。公司开展原材料期货套期保值业务是可行的，公司开展期货套期保值业务的相关审批程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，不存在损害公司及全体股东利益的情形。因此，我们同意公司开展原材料期货套期保值业务。

特此公告。

浙江晨丰科技股份有限公司董事会

2022年1月20日