

证券代码：600673

证券简称：东阳光

编号：临 2022—15 号

债券代码：163049

债券简称：19 东科 02

广东东阳光科技控股股份有限公司

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。

广东东阳光科技控股股份有限公司（以下简称“公司”）于 2022 年 2 月 14 日召开第十一届董事会第十二次会议，审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》。现将相关情况公告如下：

一、套期保值的目的

为规避原材料价格波动给公司带来的经营风险，公司决定选择利用期货工具的避险保值功能，由公司下属子公司择机开展期货套期保值业务，控制公司生产成本，有效规避市场价格波动风险，保障主营业务稳步发展。

二、开展套期保值业务的基本情况

本次套期保值业务的交易品种限于与公司生产经营相关的原材料品种，包括但不限于铝锭等。开展套期保值业务的保证金金额不超过人民币 20,000 万元，投资期限为自董事会审议通过之日起 12 个月内，上述额度在投资期限内可循环滚动使用。资金来源为公司自有资金，不涉及募集资金。

三、套期保值面临的风险

1、市场风险：如市场发生系统性风险，期货价格与现货价格走势相背离等，可能造成交易损失。

2、政策风险：如期货市场相关法规政策发生重大变化，可能导致市场发生剧烈波动或无法交易的风险。

3、流动性风险：如果合约活跃度较低，导致套期保值持仓无法成交或无法在合适价位成交，令实际交易结果与方案设计出现较大偏差，造成交易损失。

4、操作风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善或操作失误所造成的风险。

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。

四、套期保值的风险控制措施

1、严格执行有关法律法规，建立有效的监督检查、风险控制和交易止损机制，并严格在董事会批准的权限内办理公司期货套期保值业务。

2、在制订交易方案的同时做好资金测算，以确保可用资金充裕；严格控制套期保值的资金规模，合理规划和使用资金，在市场剧烈波动时做到合理止损有效规避风险。

3、合理设置公司期货业务组织机构，建立岗位责任制，明确各相关部门和岗位的职责权限。同时提升相关人员的专业知识，定期组织业务关联岗位培训，强化业务流程学习，增加风险管理及防范意识，提高从业人员专业素养。

4、根据业务需要，在公司主管财务部门安排指定人员进行账目处理、资金调拨，并跟踪账目结算，并向上级主管领导汇报资金使用情况，完善内部资金监管机制。

5、遵循锁定项目利润、套期保值原则，不做投机性、套利性期货交易操作。密切跟踪市场行情变化，关注价格走势，合理计划和安排使用保证金，尽可能降低交易风险。

五、独立董事意见

我们认为，在保证正常生产经营的前提下，公司子公司本次使用自有资金开展铝期货套期保值计划，有利于充分利用期货市场的套期保值功能，降低原材料市场价格波动可能带来的经营风险，有利于提高公司整体抵御风险能力。本次业务的期货品种与公司生产经营相关，不存在损害公司和全体股东利益的情况。该事项审议和决策程序符合《上海证券交易所股票上市规则》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第5号——交易与关联交易》等相关规定要求；同意公司使用自有资金开展铝期货套期保值业务，同时提请公司严格按照公司制定的《东阳光套期保值业务管理制度》开展相关业务。

特此公告。

广东东阳光科技控股股份有限公司

2022年2月15日