

## 索通发展股份有限公司

### 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法律责任。

#### 重要内容提示：

● 为进一步降低相关能源及产品等市场价格波动对生产经营及主营产品价格的影响，提升整体抵御风险的能力，增强财务稳健性，索通发展股份有限公司（以下简称“公司”）全资子公司拟使用不超过人民币2,000万元和美元150万元自有资金开展铝锭等产业链相关商品的期货套期保值业务。

● 已履行的审议程序：公司于2023年4月26日召开的第五届董事会第五次会议审议通过《关于开展期货套期保值业务的议案》。本议案无需提交公司股东大会审议。

● 特别风险提示：公司进行期货套期保值业务以对现货保值为目的，主要为有效规避生产用能源及产业链产品价格波动给公司带来的不利影响，但套期保值业务仍受价格波动风险、政策风险、流动性风险、技术风险等因素影响，具备一定投资风险，敬请广大投资者审慎决策，注意投资风险。

#### 一、交易情况概述

##### （一）交易目的

为进一步降低相关能源及产品等市场价格波动对生产经营及主营产品价格的影响，提升整体抵御风险的能力，增强财务稳健性，公司全资子公司临邑索通国际工贸有限公司（以下简称“临邑工贸”）和索通香港物料有限公司（以下简称“香港物料”）计划开展铝锭等产业链相关商品的期货套期保值业务。开展期货套期保值业务不会影响公司主营业务的发展及资金的使用安排。

##### （二）交易金额

公司拟使用不超过人民币 2,000 万元和美元 150 万元自有资金开展商品期货

套期保值业务，其中，临邑工贸从事套期保值交易的最高保证金及权利金为人民币 2,000 万元，香港物料从事套期保值交易的最高保证金及权利金为美元 150 万元。

### （三）资金来源

公司自有资金。

### （四）交易方式

根据公司经营目标及生产情况，预计 2023 年度铝锭套期保值持仓最大数量不超过 5,000 吨。期货头寸跟现货库存数据相匹配，持有现货多头数量跟期货空头数量保持一致。

### （五）交易期限

上述额度有效期为自董事会审议通过之日起至 2024 年年度董事会关于开展期货套期保值业务相关议案通过之日止，有效期内上述额度可循环使用。

## 二、审议程序

公司于 2023 年 4 月 26 日召开的第五届董事会第五次会议审议通过《关于开展期货套期保值业务的议案》。本议案不涉及关联交易，无需提交公司股东大会审议。

## 三、交易风险分析及风控措施

公司进行期货套期保值业务以对现货保值为目的，主要为有效规避生产用能源及产业链产品价格波动给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商品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）技术风险：由于无法控制或不可预测的系统、网络、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，从而带来相应的风险和损失。

为控制期货交易风险，公司将采取以下风险控制措施：

(一) 公司制定了期货套期保值业务的相关管理制度，明确了开展套期保值业务的组织机构及职责、审批授权、交易流程、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) 控制套期保值交易总仓位，根据市场情况分批投入保证金及权利金。

(三) 分散投资，对近期和远期品种进行分散资金配置。

(四) 严控操作流程，以公司数据分析出的市场指标为依据，通过内部审批流程后再进行相应操作，操作结果形成记录，盈亏情况随时更新上报。

(五) 严守套期保值原则，严格执行相关内部控制制度，并采取有效的风险防范措施，跟踪市场情况变化，及时评估已交易期货的风险敞口变化情况，控制风险。

#### **四、交易对公司的影响及相关会计处理**

根据财政部《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》和《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》的相关规定，在公司定期报告中对开展的期货套期保值业务进行相应的会计核算处理并披露。

#### **五、独立董事意见**

公司全资子公司开展商品期货套期保值业务，有利于进一步降低相关能源及产品等市场价格波动对生产经营及主营产品价格的影响，提升整体抵御风险的能力，增强财务稳健性，不存在损害公司和全体股东利益的情形；公司已制定了期货套期保值业务的管理制度，通过加强内部控制，落实风险防范措施；相关审议程序符合《上海证券交易所股票上市规则》《公司章程》等的规定。我们同意《关于开展期货套期保值业务的议案》。

特此公告。

索通发展股份有限公司董事会

2023 年 4 月 28 日