

证券代码：601636

证券简称：旗滨集团

公告编号：2023-100

可转债代码：113047

可转债简称：旗滨转债

株洲旗滨集团股份有限公司

关于继续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：

● 期货业务品种：拟开展的套期保值业务品种为郑州商品交易所上市的纯碱期货（实物为重质纯碱），上海期货交易所上市的锡期货、白银期货，结算币种均为人民币。

● 授权额度：公司套期保值业务授权额度必须同时满足以下条件：

（1）套期保值业务最高持仓合约金额不超过人民币5亿元，即授权期限内任一时点的持仓合约金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过上述额度；

（2）预计动用的最高交易保证金和权利金（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）额度不超过人民币1亿元。有效期内可循环使用。

● 决议有效期限及额度使用期限：决议有效期限及以上额度的使用期限自董事会审议通过之日起12个月内有效（2023年9月25日-2024年9月24日），在上述额度及决议有效期内，可循环滚动使用。单笔业务的期限不超过12个月，如单笔业务的存续期超过了决议的有效期，则额度及决议的有效期自动顺延至该笔业务终止时止。

● 该事项已经公司于2023年9月25日召开的第五届董事会第十九次会议审议通过，该等业务不构成关联交易，根据《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》及《公司章程》《株洲旗滨集团股份有限公司套期保值管理制度》的有关规定，该事项无需提交公司股东大会审议。

公司董事会关于开展商品期货套期保值业务的额度授权使用期限即将到期。根据期货业务相关监管法规和《株洲旗滨集团股份有限公司套期保值管理制度》的有关规定，结合公司日常业务需要，公司拟继续开展生产所需的部分大宗原材料（包括纯碱、锡、白银三个品种）采购过程中的期货套期保值业务，以锁定公司纯碱、锡、白银的相关采购成本，有效防范和化解部分大宗材料采购价格波动风险。公司本次拟开展的期货套期保值业务的最高持仓合约金额不超过人民币 5 亿元（额度维持不变），且预计动用的最高交易保证金和权利金额度不超过人民币 1 亿元。现特将相关情况说明如下：

一、前期期货套期保值业务实施情况

1、套保业务额度及审批情况。2022 年 10 月 18 日，公司召开第五届董事会第六次会议审议并通过了《关于继续开展期货套期保值业务的议案》，同意公司继续开展期货套期保值业务。公司开展的套期保值业务品种为郑州商品交易所上市的纯碱期货（实物为重质纯碱），上海期货交易所上市的锡期货、白银期货，结算币种均为人民币。所有期货业务期限不超过 12 个月（自 2022 年 10 月 18 日起至 2023 年 10 月 17 日期间有效），持仓合约金额不超过人民币 5 亿元，到期采用对冲平仓或实物交割的方式。

2、套保业务实施情况。公司根据实际生产经营对纯碱的需求规模，合理确定开展纯碱期货套期保值业务的规模，严格控制期货交易的数量与资金规模，确保公司的正常生产经营，同时公司不断建立健全期货风险管理机制，加强期货业务的风险管控。公司前次审批期货套期保值业务期限自 2022 年 10 月 18 日起至 2023 年 10 月 17 日。截至 2023 年 9 月 22 日，公司（含子公司）在前次期限内期货套期保值业务的累计开仓合约 0 万元，期末持仓合约余额为 0 万元，期间最高持仓合约金额为 5,124 万元（为 2021 年 11 月 1 日-2022 年 10 月 31 日业务期限内的存续持仓）；持仓未超过公司董事会授权额度。截止 2023 年 9 月 22 日，公司期货合约保证金占用余额为 0 万元（最高保证金占用金额为 608.4 万元），授权期内公司期货合约已结束交易账面收益总额为-101.64 万元（其中冲减存货成本 0 万元，计入公允价格变动损益-101.64 万元），占公司 2022 年度经审计归母净利润的 0.08%。2022 年度公司期货合约收益总额为 622.20 万元，占公司 2022 年度经审计归母净利润的 0.5%。

二、本次拟继续开展的期货套期保值业务概述

纯碱、锡、白银是商品期货市场主要的交易品种，企业通过金融市场套期保值以辅助正常的生产经营秩序已成为经营管理的必要手段。公司已制定《株洲旗滨集团股份有限公司套期保值管理制度》，严格根据生产经营对纯碱、锡、白银的需求规模确定开展套期保值的业务规模，通过期货套期保值锁定材料价格，同时建立健全期货产品的风险管理机制，加强套期保值的风险管控。

1、期货业务品种：拟开展的套期保值业务品种为郑州商品交易所上市的纯碱期货（实物为重质纯碱），上海期货交易所上市的锡期货、白银期货，结算币种均为人民币。

2、合约期限：公司所开展的纯碱、锡、白银期货业务期限不超过 12 个月。

3、交易对手：大宗材料生产商、期货经纪公司。

4、授权额度：公司套期保值业务授权额度必须同时满足以下条件：

（1）套期保值业务最高持仓合约金额不超过人民币 5 亿元，即授权期限内任一时点的持仓合约金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过上述额度；

（2）预计动用的最高交易保证金和权利金（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）额度不超过人民币 1 亿元。有效期内可循环使用。

5、其他安排：拟开展的期货业务主要使用现汇，额度比例及交易的杠杆倍数一般在 10 以内，到期采用对冲平仓或实物交割的方式。

6、决议有效期限及额度使用期限：决议有效期限及以上额度的使用期限自董事会审议通过之日起 12 个月内有效（2023 年 9 月 25 日-2024 年 9 月 24 日），在上述额度及决议有效期内，可循环滚动使用。单笔业务的期限不超过 12 个月，如单笔业务的存续期超过了决议的有效期，则额度及决议的有效期自动顺延至该笔业务终止时止。

7、资金来源：自有资金。

三、继续开展期货套期保值业务的必要性说明

公司专业从事玻璃产品制造、研发和销售业务,生产经营中需要大量的纯碱、锡、白银作为原材料。近年来,随着国际、国内经济形势以及市场供需关系的变化,纯碱、锡、白银的价格波动较大。

原材料价格的波动直接影响公司的经营业绩,会给公司生产经营带来风险,公司的持续盈利水平也将受到挑战,企业通过金融市场套期保值以辅助正常的生产经营秩序已成为经营管理的必要手段。利用期货市场的套期保值功能,规避和减少因原材料纯碱、锡、白银价格波动引起的采购成本波动带来的经营风险,符合公司日常经营之所需。公司将严格根据生产经营对纯碱、锡、白银的需求规模确定开展套期保值的业务规模,同时公司不断建立健全期货业务的风险管理机制,进一步加强了套期保值的风险管控。

为有效规避市场风险,减少和降低大宗原材料价格大幅波动对公司主营业务的不利影响,公司及下属子公司拟继续利用商品期货市场开展套期保值业务。

四、开展套期保值业务的可行性说明

1、公司根据《企业内部控制基本规范》《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》等相关法律法规已制定《株洲旗滨集团股份有限公司套期保值管理制度》,对套期保值业务品种范围、审核流程、审批权限、内部控制和风险管理、信息保密等作出了明确的规定。将套期保值业务与公司生产经营相匹配,期现结合,规范合理操作,能够有效保证期货业务的顺利进行,并对风险形成有效控制。

2、公司建立了套期保值业务组织机构,明确了董事会、期货领导小组、期货交易小组、期货结算小组、期货风控小组各个层级的职责与权限。公司将在实际运行过程中,进一步完善各项工作细节,保证业务操作清晰、资金管理清晰、风险控制清晰,最大程度实现开展套期保值业务的目的。

3、公司目前经营稳定,资金管理方面具有较为成熟的经验,同时自有资金较为充裕,严格遵守上市公司监管相关规定使用自有资金开展套期保值业务,不使用募集资金直接或者间接进行套期保值业务。对于纯碱、锡、白银套期保值业务所需的保证金等资金调拨,以公司目前自有资金规模能持续且稳定提供其所需

流动性，不影响公司日常经营业务的正常开展。

因此，公司继续适当开展上述部分大宗原材料期货套期保值业务是切实可行的。

五、履行的决策程序

（一）公司于2023年9月25日召开独立董事专门会议2023年第一次会议，审议通过了《关于继续开展期货套期保值业务的议案》，独立董事认为：

1、公司开展纯碱、锡、白银期货套期保值业务是为规避原材料价格波动风险、有效控制采购成本而采取的合理措施，有利于保证公司盈利的稳健性，符合公司生产经营和战略发展需要。公司开展期货套期保值业务不以投机和套利交易为目的，有利于公司稳健经营和持续发展。

2、公司制定了《株洲旗滨集团股份有限公司套期保值管理制度》《株洲旗滨集团股份有限公司套期保值业务方案》，提出了相应的风险控制措施，对纯碱、锡、白银期货套保业务的操作环节和流程作了明确规定，可以有效控制业务操作风险。

3、公司使用自有资金继续开展期货套期保值业务，不涉及使用募集资金，符合法律、法规及《公司章程》的规定。

4、纯碱、锡、白银期货套期保值业务符合相关政策要求和公司的发展需要，该事项不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。

因此，我们同意公司继续开展期货套期保值业务。

（二）公司于2023年9月25日召开第五届董事会第十九次会议，审议通过了《关于继续开展期货套期保值业务的议案》。

（三）公司于2023年9月25日召开第五届监事会第十九次会议，审议通过了《关于继续开展期货套期保值业务的议案》，监事会认为：

1、公司继续开展期货套期保值业务是为充分利用商品期货市场的套期保值功能，规避纯碱、锡、白银等原材料价格波动带来的经营风险，锁定采购价格降低生产成本而采取的有效应对措施，有利于确保公司年度经营目标的实现，符合公司未来经营发展需要，风险可控，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。

2、公司继续开展期货套期保值业务履行了相关审批程序，符合国家相关法律、法规及《公司章程》有关规定。

3、公司已制定了《株洲旗滨集团股份有限公司套期保值管理制度》，通过进一步加强内部控制，落实风险防范措施，为公司继续从事套期保值业务制定了具体操作规程，可有效控制和防范套期保值业务相关风险。

我们同意公司继续开展期货套期保值业务，同意公司提出的本期交易额度。

（四）本次拟开展的期货业务不构成关联交易，根据《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》及《公司章程》《株洲旗滨集团股份有限公司套期保值管理制度》的相关规定，该事项无需提交公司股东大会审议。

六、期货业务风险及应对措施

公司开展纯碱、锡、白银期货套期保值业务，主要目的是规避和防范现货交易中价格波动所带来的经营风险，但由于期货业务自身特点，开展套期保值业务同时也存在一定的风险，包括宏观经济、政策风险、市场风险、流动性风险、履约风险、强平风险、内部控制风险等。

公司开展纯碱、锡、白银期货套期保值业务与公司生产经营相匹配，按照锁定大宗材料采购成本、稳定生产经营的原则，依据制度规定开展业务。公司期货业务仅限于生产所需纯碱、锡、白银保值、避险的运作，不以逐利为目的，套保业务数量控制在年度需求量的合理比例。依据对整体金融与商品市场的深入分析，对公司年度纯碱、锡、白银的现货采购需求量，采取一定比例进行买入保值。严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用，严格按照制度规定进行流程审批后操作，并在制定期货交易计划同时制定资金调拨计划，既要确保正常经营，又要防止由于资金问题造成机会错失或持仓过大保证金不足被强行平仓风险。加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，及时合理地调整套期保值思路与方案。公司期货套期保值交易方案设定止损目标，将损失控制在一定的范围内，防止由于市场出现系统性风险造成严重损失。

七、会计政策及核算原则

公司根据财政部《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》《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，对拟开展的期货套期保值业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目。

八、备查文件

- 1、旗滨集团套期保值业务方案；
- 2、旗滨集团套期保值管理制度；
- 3、独立董事专门会议2023年第一次会议决议；
- 4、第五届董事会第十九次会议决议；
- 5、第五届监事会第十九次会议决议；
- 6、监事会关于公司第五届监事会第十九次会议相关事项的审核意见。

特此公告。

株洲旗滨集团股份有限公司

二〇二三年九月二十七日