股票代码：603278

股票简称：大业股份

公告编号：2021-061

山东大业股份有限公司

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。

山东大业股份有限公司（以下简称“公司”）第四届董事会第十一次会议于2021年8月27日审议通过《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、开展套期保值业务的目的

公司主要产品胎圈钢丝、钢帘线、胶管钢丝的主要原材料是盘条，为规避生产经营中因原材料盘条价格上涨和库存产品价格下跌带来的风险，公司计划利用商品期货和期权进行套期保值业务操作。

二、套期保值业务概述

（一）拟投资的期货、期权品种：国内商品交易所已挂牌的螺纹钢、线材等与公司生产经营相关的产品或者所需的原材料对应的品种。

（二）拟投入的资金金额：根据公司经营目标，预计公司及子公司开展商品套期保值业务所需保证金最高占用额不超过人民币五亿元，有效期内可循环使用。

（三）资金来源：公司自有资金。

（四）拟开展套期保值时间：自公司董事会审议通过之日起12个月内有效。

三、公司开展套期保值业务的风险分析

套期保值操作可以有效管理原材料的采购价格风险，特别是减少原料价格大幅下跌时较高库存带来的跌值损失，降低因原料价格急剧上涨时市场货源紧张无法快速建库的机会损失。但套期保值在开展中，存在一定的风险：

（一）市场风险。套期保值交易需要对价格走势作出预判，一旦价格预测发生方向性错误有可能给公司造成损失。

（二）政策风险。套期保值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。

（三）流动性风险。在套期保值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套期保值市场。

（四）操作风险。套期保值交易系统相对复杂，可能存在操作不当产生的风险。

（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，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、公司采取的风险控制措施

公司套期保值按照决策、执行、监督职能相分离的原则，建立适当的审批和执行程序，确保套期保值交易有效开展和规范运行，确保资金安全。

（一）公司制定了《套期保值业务管理制度》，该制度对公司开展期货套期保值业务的审批权限、操作流程及风险控制等方面做出了明确的规定，各项措施切实有效且能满足实际操作的需要，同时也符合监管部门的有关要求。

（二）公司的套期保值业务规模将与公司经营业务相匹配，最大程度对冲价格波动风险。期货套期保值交易仅限于在境内期货交易且与公司经营业务所需的材料相关性最高的商品期货品种，杜绝一切以投机为目的的交易行为。

（三）公司以自己名义设立套期保值交易账户，使用自有资金，不会使用募集资金直接或间接进行套期保值。公司将严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，对保证金的投入比例进行监督和控制，在市场剧烈波动时及时平仓规避风险。

（四）公司将严格按照相关内控制度安排和使用专业人员，建立严格的授权与岗位牵制机制，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

（五）设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展，当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。

(六) 公司将定期及不定期对套期保值交易业务进行检查，监督套期保值交易业务人员执行风险管理政策和风险管理工作程序，及时防范业务中的操作风险。

五、独立董事意见

独立董事对公司开展期货套期保值业务，发表如下独立意见：

公司使用自有资金开展套期保值业务的相关审批程序符合有关法律法规、规范性文件及《公司章程》的规定。公司开展套期保值业务，有利于公司充分利用期货市场的套期保值功能，提高抵御原材料市场价格波动风险的能力，不存在损害公司和全体股东利益的情形。公司已制定了《期货保值业务管理制度》，建立健全了组织机构、业务操作流程、审批流程及风险控制措施，形成了较为完整的风险管理体系。公司独立董事一致同意公司开展期货套期保值业务。

特此公告。

山东大业股份有限公司董事会

2021年8月28日