

证券代码：605208

证券简称：永茂泰

公告编号：2022-033

上海永茂泰汽车科技股份有限公司 关于开展期货套期保值业务的进展公告

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。

一、本次期货套期保值业务概述

上海永茂泰汽车科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 4 月 23 日召开第二届董事会第五次会议，审议通过《关于授权管理层开展期货套期保值业务的议案》，为了避免公司及子公司生产所需铝、铜、镍等大宗金属原材料价格波动风险，保证产品成本的相对稳定，董事会授权公司管理层在 8,000 万元初始交易保证金额度内（上海期货交易所规定的最低交易保证金，不包括节假日临时追加保证金和实物交割前追加保证金）在未来一年内择机开展原材料和产品期货套期保值业务。具体内容详见公司于 2021 年 4 月 26 日披露的《关于授权管理层开展期货套期保值业务的公告》（公告编号：2021-018）。本议案经公司 2021 年 5 月 28 日召开的 2020 年度股东大会审议通过。

此外，公司于 2022 年 3 月 10 日召开第二届董事会第八次会议，审议通过了《关于授权管理层开展期货套期保值业务的议案》，为了避免公司及子公司生产所需铝、铜、镍等大宗金属原材料价格波动风险，保证产品成本的相对稳定，同时为了防止公司及子公司铝合金库存商品跌价的风险，锁定产品的加工利润，董事会同意授权公司管理层在 1 亿元初始交易保证金额度内（上海期货交易所规定的最低交易保证金，不包括节假日临时追加保证金和实物交割前追加保证金）在未来一年内择机开展原材料和产品期货套期保值业务。具体内容详见公司于 2022 年 3 月 11 日披露的《关于授权管理层开展期货套期保值业务的公告》（公告编号：2022-013）。本议案经公司 2022 年 4 月 22 日召开的 2021 年度股东大会审议通过。

二、本次期货套期保值业务进展

在上述授权范围内，根据未来生产需求和采购计划及对铝、铜、镍等大宗金属价格预判，公司及子公司陆续买入了相应数量的铝、铜、镍期货看涨合约，并严格执行公司《套期保值管理制度》和风险控制措施。但受 2022 年以来国际地缘政治冲突、上海疫情、美联储加息等宏观因素叠加影响，在对公司生产经营、产销量造成较大不利影响的同时，大宗金属期货价格出现大幅波动，公司及子公司所买入套期保值的铝、铜、镍期货价格呈下跌趋势。2022 年 7 月 1 日，公司收到期货交易员通知，自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日下午收盘，公司及子公司期货账户累计亏损 4,039.74 万元（其中持仓浮亏 1,516.42 万元），对本年度损益的影响金额为-3,133.55 万元。

三、风险分析及风险控制措施

（一）风险分析

公司及子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：

1、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。

2、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。

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。

4、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。

（二）风险控制措施

针对上述风险，公司及子公司拟采取的风险控制措施如下：

1、公司制定了《套期保值管理制度》，对期货交易业务的审批权限、内部审

核流程、风险处理程序等作出了明确规定，并设立期货交易的专门组织机构，配备相关人员，按照期货交易需要实施严格分工，分析、决策、交易、风险控制等岗位严格分离，各司其职。

2、期货交易品种均与公司正常经营业务相关，不得开展与公司正常经营业务无关的期货交易。

3、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，公司及子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。

4、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。

5、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。同时，公司审计部定期或不定期对套期保值业务进行检查，监督套期保值工作的开展，控制风险。

四、对公司的影响

因上述期货账户亏损，将影响公司 2022 年度损益金额为-3,133.55 万元。上述事项对公司财务数据的影响未经审计，具体准确的财务数据以公司正式披露的经审计后数据为准，敬请广大投资者注意投资风险。

为减少相关风险，公司将严格遵守《套期保值管理制度》和风险控制措施，同时，鉴于当前经济形势可能导致的期货市场大幅波动风险，公司将严格控制期货套期保值业务的资金规模，不再转入资金，并逐步减少仓位。同时，公司将加强对国家及相关管理机构政策的把握和理解，有效防范、发现和化解风险，确保进行期货交易的资金相对安全，不会影响公司业务的正常开展。

特此公告。

上海永茂泰汽车科技股份有限公司董事会

2022 年 7 月 2 日