

证券代码：603871

证券简称：嘉友国际

公告编号：2022-099

## 嘉友国际物流股份有限公司

### 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。

嘉友国际物流股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年9月29日召开第三届董事会第二次会议审议通过《关于开展期货套期保值业务的议案》，同意公司开展与日常经营相关的商品期货套期保值业务，现将相关事项公告如下：

#### 一、目的和必要性

为了有效对冲大宗矿产品价格大幅波动带来的风险，保证公司供应链贸易服务业务发展，利用期货市场的套期保值功能，对公司日常经营相关的主要商品风险敞口择机开展套期保值业务，提升公司防御风险能力，保障公司持续稳定运营，符合《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》等相关规定。

#### 二、业务基本情况

- （一）投资品种：铜精矿、煤炭等与公司日常经营相关的大宗商品。
- （二）投资金额：开展期货套期保值所需保证金不超过人民币2亿元。
- （三）资金来源：公司自有资金。
- （四）实施主体：公司及控股子公司。
- （五）授权期限：自董事会审议通过之日起12个月内。

#### 三、风险分析

公司进行商品期货套期保值业务不以投机为目的，主要是为防范商品价格波动对公司日常经营带来的影响，但同时也会存在一定的风险，主要如下：

（一）价格波动风险：受国际及国内经济政策和形势、汇率和利率波动等多种因素影响，期货行情与现货市场走势背离，不能完全对冲风险或锁定盈亏，使公司供应链贸易服务业务收入存在一定的不确定性。

(二) 内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于公司内部控制体系不完善而造成风险。

(三) 资金风险：期货交易实行保证金制度，如投入金额较大，可能会带来相应的资金风险，甚至可能存在未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失的风险。

(四) 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，从而带来相应的技术风险。

#### **四、风险控制措施**

(一) 公司已建立期货套期保值业务的相关管理制度，规定了开展期货套期保值交易业务的机构、职责分工、报告流程及风险处理程序等内容，通过严格管理、规范执行，有效防范、发现和化解风险。

(二) 严格控制公司期货套期保值交易业务品种与规模，使之与公司经营业务相匹配，以对冲风险和锁定盈亏为目的，杜绝投机行为。

(三) 按照相关资金管理制度，合理调度自有资金用于套期保值业务，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。

(四) 公司审计部定期或不定期对期货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。

(五) 加强期货套期保值业务相关人员专业知识学习和培训，提高专业素养。

#### **五、对公司的影响**

公司开展期货套期保值业务，主要为了规避大宗矿产品价格波动给公司带来的不利影响，加强风险管理、提升风险防控能力，保障业务稳健发展。

公司将根据《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》等相关规定及其指南，对期货套期保值业务进行相应核算和披露。

#### **六、审议程序**

(一) 董事会审议情况

2022 年 9 月 29 日，公司第三届董事会第二次会议审议通过《关于开展期货套期保值业务的议案》，本议案无需提交股东大会审议。

## （二）独立董事意见

公司及控股子公司开展与公司日常经营相关的大宗商品期货套期保值业务，履行了必要的审批程序，符合相关法律法规和《公司章程》的有关规定；公司已建立套期保值业务管理制度，形成了较为完善的风险管理体系；开展期货套期保值业务有利于防范大宗商品价格波动所带来的经营风险，提升公司防御风险能力，保障公司持续稳定运营，不存在损害公司及股东特别是中小股东利益的情形，同意公司开展期货套期保值业务。

特此公告。

嘉友国际物流股份有限公司董事会

2022年9月30日