

证券代码:600982
债券代码:185462

证券简称:宁波能源
债券简称:GC甬能01

公告编号:临2023-027

宁波能源集团股份有限公司

关于授权经营层开展商品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。

重要内容提示:

- 交易目的:** 为规避市场价格波动、锁定预期利润、控制运营风险,宁波能源集团股份有限公司(以下简称“公司”)拟开展商品套期保值业务。
- 交易品种、工具及场所:** 交易品种仅限于与公司现有业务相关的煤炭、天然气、原油、石油焦、燃料油、沥青、PTA和橡胶等能源化工产品,通过上海期货交易所、上海国际能源交易中心、郑州商品交易所、大连商品交易所等境内商品交易所制定的能源化工类商品期货合约开展套期保值。
- 交易金额:** 连续12个月内套期保值业务保证金最高占用额不超过人民币20,000万元,在手期货合约对应的商品总值不得超过200,000万元。
- 履行的审议程序:** 经公司第七届董事会第三十七次会议审议通过,本事项无需提交公司股东大会审议。
- 特别风险提示:** 公司开展套期保值业务以规避市场价格波动所带来的风险为目的,不进行投机性的交易操作,但相关套期保值业务操作仍存在市场、操作、资金、技术、政策等风险,敬请投资者注意投资风险。

一、交易情况概述

(一) 交易目的

公司经营商品贸易业务主要品种包括与公司现有业务相关的煤炭、天然气、原油、石油焦、燃料油、沥青、PTA和橡胶等能源化工产品。大宗商品受市场供求、地缘政治、行业周期、利率、汇率变动等多种因素作用,价格波动频繁。公司开展商品套期保值业务,是为了规避市场价格波动,锁定预期利润,控制运营

风险。

（二）交易金额

在连续12个月内套期保值业务保证金最高占用额不超过人民币20,000万元，在手期货合约对应的商品总值不得超过200,000万元。

（三）资金来源

公司开展商品套期保值业务的资金来源为自筹资金。

（四）交易方式

公司开展商品套期保值交易品种仅限于与公司现有业务相关的煤炭、天然气、原油、石油焦、燃料油、沥青、PTA和橡胶等能源化工产品。公司通过上海期货交易所、上海国际能源交易中心、郑州商品交易所、大连商品交易所等境内商品交易所制定的期货合约开展套期保值。

（五）交易期限

授权期限自2022年度股东大会审议通过之日起至2023年度股东大会止。

二、审议程序

公司于2023年4月14日召开第七届董事会第三十七次会议，审议通过《关于授权经营层开展商品套期保值业务的议案》，独立董事发表了同意的意见。

三、交易风险分析及风控措施

（一）开展套期保值业务可能存在基差、政策、资金流动性、操作、技术、对手方违约等方面的风险。

1、政策风险：期货市场政策法规发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易等风险。

2、基差风险：期货价格与现货价格走势背离所带来的期货市场、现货市场均不利的风险。

3、资金风险：在期货价格波动大时，可能产生因未及时补充保证金而被强行平仓造成实际损失的风险。

4、违约风险：场内对手交割方不具备履约能力，或场外做市商无力履约所造成的风险。

5、操作风险：期货交易专业性较强，若专业人员配置不足、内控不完善，会产生相应风险。

6、技术风险：由于软件、硬件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。

（二）采取的风险控制措施

1、套期保值业务与生产经营情况相匹配，严格控制套期保值头寸，并实施动态监管。

2、已建立完整的组织机构，定期制定套保策略，由业务部门开展套期保值操作业务，配备商务、风控、合规等专业人员，明确相应人员的职责、相关业务操作流程、审批程序和保密制度，建立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统。

3、已制定参与期货交易管理办法、业务风险管理制度等较为完善的套期保值业务相关管理制度，在整个套期保值操作过程中所有业务都将严格按照上述制度执行。

4、将加强相关人员的专业知识培训，提高套期保值从业人员的专业素养。

5、合理调度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。

6、加强对能源化工的产业、商品价格和汇率的研究分析，实时关注国际国内市场环境变化，适时调整操作策略。

7、严格遵守国家有关法律法规的规定，防范法律风险，定期对套期保值业务的规范性、内控机制的有效性等方面进行监督检查，按相关规则要求适时履行信息披露义务。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司开展的商品套期保值业务品种在国内外公开市场交易，透明度大，信用风险小，成交价和结算价可以充分反映衍生品的公允价值。

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37号-金融工具列报》等相关规定进行相应的确认和计量。

以上业务的开展有利于提高公司经营能力，不存在损害公司和股东利益的情形。

五、独立董事意见

公司开展商品套期保值业务，旨在充分利用金融市场的套期保值功能，提高

公司抵御市场波动和平抑价格震荡的能力。本次开展套期保值业务的相关审批程序符合相关法律法规及《公司章程》的有关规定。同时，公司已制定套期保值业务的内控管理制度，建立了相应的组织机构和业务流程，具备开展业务相适应的资金实力和抗风险能力。公司开展商品套期保值业务是可行的，不存在损害公司和全体股东利益的情形，同意公司开展商品套期保值业务。

特此公告。

宁波能源集团股份有限公司董事会

2023年4月18日