

证券代码：603618

证券简称：杭电股份

编号：2023-020

转债代码：113505

转债简称：杭电转债

杭州电缆股份有限公司

关于公司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：

- 交易目的：杭州电缆股份有限公司（以下简称“公司”）开展套期保值业务，主要为充分利用期货市场的套期保值功能，合理规避主要原材料价格波动风险，降低原料市场价格波动对公司生产经营成本及主营产品价格的影响，提升公司整体抵御风险能力，维护正常生产经营活动。
- 交易品种及场所：与公司生产经营相关的大宗商品原料，如铜、铝等境内外商品交易所制定的标准合约及金融衍生品。
- 交易金额：公司拟使用不超过人民币3亿元的自有资金开展套期保值业务，上述额度在有效期内可循环滚动使用，任一时点的交易金额不超过授权的额度（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）。
- 已履行及拟履行的审议程序：公司于2023年4月25日召开了第四届董事会第十八次会议审议通过了《关于公司开展期货套期保值业务的议案》，独立董事发表了同意的独立意见，该议案尚需提交2022年年度股东大会审议。
- 特别风险提示：公司开展套期保值业务遵循稳健原则，以合法、谨慎、安全和有效为原则，不以套利、投机为目的，主要是用来规避由于原材料价格的波动所带来的风险，但进行期货套期保值交易仍可能存在价格波动风险、政策风险、流动性风险、资金风险、内部控制风险、技术风险等，公司积极落实风险控制措施，审慎操作，防范相关风险。敬请投资者注意投资风险。

一、交易情况概述

（一）交易目的

公司开展商品期货套期保值业务，主要是因为大宗商品（铜、铝）是公司生产产品的重要原材料，采购价格受市场价波动影响较大，为降低原材料市场价格波动带来的不可控风险，减少原材料价格波动对公司生产经营造成的不确定影响，提升公司整体抵御风险能力，确保公司生产经营的正常、稳定运行，公司决定充分利用期货市场的套期保值功能，开展期货套期保值业务，公司期货套期保值业务使用自有资金进行操作，不作为盈利工具使用。

（二）期货套期保值业务的基本情况

1、套期保值交易品种：与公司生产经营相关的大宗商品原料，如铜、铝等境内商品交易所制定的标准合约及金融衍生品。

2、套期保值业务计划额度：根据业务实际需求，公司预计投入商品期货套期保值业务的最高保证金额度不超过人民币3亿元，有效期内可循环滚动使用。

3、套期保值业务授权及期限：授权期限自公司2022年年度股东大会审议通过之日起至2023年年度股东大会召开之日止，在授权有效期内额度可循环滚动使用。如单笔交易的存续期限超过了授权期限，则授权期限自动顺延至该笔交易终止时止，但该笔交易额度纳入下一个审批有效期计算。

4、资金来源：套期保值业务资金来源为公司自有资金，不存在使用募集资金的情形。

二、审批程序

公司于2023年4月25日召开的第四届董事会第十八次会议以同意9票，反对0票，弃权0票的表决结果审议通过了《关于公司开展期货套期保值业务的议案》，同意公司根据《上海证券交易所股票上市规则》等相关法律法规及公司《商品期货套期保值业务管理制度》的规定，开展商品期货套期保值业务，拟投入的保证金额不超过人民币3亿元，上述额度在授权期限内可滚动使用，上述议案尚需提交公司2022年年度股东大会审议，本次开展商品期货套期保值业务的期限及决议有效期为2022年年度股东大会审议通过之日起至2023年年度股东大会召开之日止。

三、交易风险分析及风控措施

公司开展期货套期保值业务主要为有效规避主要商品价格波动对其带来的影响，但同时也会存在一定的风险，具体如下：

1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险而造成套期保值损失。

2、政策风险：宏观政策及期货市场法律法规等相关政策发生重大变化，可能引起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、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。

5、内部控制风险：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。

公司采取的风险控制措施如下：

1、公司已制定《期货及衍生品套期保值业务管理制度》，对商品期货套期保值业务的风险控制、审议程序、后续管理和信息披露等做出明确规定，公司将严格按照此制度规定对各个环节进行控制，同时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。

2、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。

3、公司将重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

4、公司将严格控制套期保值业务的种类及规模，合理计划和使用保证金，

使用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，加强资金管理的内部控制，不得超过批准的保证金额度；同时依据账户风险程度，及时平衡、调拨账户可用资金，防范账户持仓风险。

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。

6、优化交易环境，建立“安全、快捷”的软硬件交易环境，保证交易系统的流畅运行。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

（一）对公司的影响

通过开展期货套期保值业务，降低原材料价格波动对公司业绩造成的不确定影响，增强生产经营稳健性。公司使用自有资金开展期货套期保值业务，投入的保证金额与自有资金、经营情况和实际需求相匹配，不会影响公司及子公司正常经营业务。

（二）会计处理

《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》及《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，对开展的期货套期保值业务进行相应的核算处理和列报披露。

五、独立董事意见

开展期货套期保值功能有利于有效防范市场风险，提高公司抵御市场波动和平抑价格震荡的能力，促进公司长期稳健地发展，公司已建立较为完善的《期货及衍生品套期保值业务管理制度》，形成了较为完整的风险管理体系；公司使用自有资金利用期货市场开展的套期保值业务的相关审批程序符合《上海证券交易所股票上市规则》、《公司章程》等的规定，不存在损害公司和全体股东利益的情形，特别是中小股东利益的情形。因此我们一致同意公司开展期货套期保值业

务，并提交2022年年度股东大会审议。

特此公告。

杭州电缆股份有限公司

董事会

2023年4月25日