

上海摩恩电气股份有限公司

关于开展期货套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证本公告内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

上海摩恩电气股份有限公司（以下简称“公司”）于2020年10月28日召开第五届董事会第三次会议，审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，同意公司使用额度不超过20,000万元的自有资金开展套期保值业务，期限为自董事会通过之日起一年。现将有关事项公告如下：

一、开展期货套期保值业务概述

1、期货套期保值业务开展的必要性和目的

公司以生产电线电缆产品为主，产品主要原材料（铜、铝）约占生产成本80%。由于铜成本占公司产品成本比例较高，如果单一在传统现货市场实施采购，其价格波动风险将无法控制，会给公司生产经营带来较大风险，公司持续盈利能力也将受到极大挑战。

为规避铜价格剧烈波动给公司生产经营带来的不确定风险，控制公司生产成本，保证公司主营业务健康、稳定增长，公司有必要利用商品期货市场的特征和规则，通过期货和现货市场对冲的方式，提前锁定公司产品和原材料的相对有利价格，积极开展商品期货及期权套期保值业务。

2、期货套期保值品种：

公司进行套期保值的品种为上海期货交易所期货沪铜合约cu。

3、拟投入资金及业务期间

公司进行套期保值业务期间为自董事会审议通过之日起一年。公司应以公司自己名义设立套期保值交易账户（含下属子公司），期货套保账户资金投入限额为人民币20,000万元。期货套期保值使用公司自有资金。董事会同意授权董事长

或相关授权人士在上述额度范围内负责具体签订（或逐笔签订）期货套期保值业务相关协议及文件。

二、套期保值的风险分析

公司套期保值业务是为了锁定原材料价格波动的风险，不做投机和套利交易，期货套期保值的数量原则上不得超过实际生产需采购的数量，期货持仓量应不超过需要保值的数量，但期货市场仍会存在一定风险：

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，造成投资损失。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金风险。

3、流动性风险：可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

4、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成风险。

5、会计风险：公司期货交易持仓的公允价值随市场价格波动可能给公司财务报表带来的影响，进而影响财务绩效。

6、客户违约风险：期货价格出现大幅波动时，客户可能违反合同的约定，取消产品订单，造成公司损失。

7、技术风险：从交易到资金设置、风险控制，到与期货公司的联络，内部系统的稳定与期货交易的匹配等，存在着因系统崩溃、程序错误、信息风险、通信失效等可能导致交易无法成交的风险。

三、公司开展期货套期保值业务的可行性分析

公司开展套期保值业务有利于规避原材料价格波动带来的市场风险，降低经营风险，具有一定的必要性，不存在损害公司及全体股东尤其是中小股东利益的情形。公司已根据相关法律法规的要求制订《期货套期保值内部控制制度》，规定公司进行套期保值业务只能以规避生产经营所需原材料及生产产品价格波动等风险为目的；并对套期保值额度、品种范围、内部流程、风险管理等作出了明确的规定，公司将严格按照《期货套期保值管理制度》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

四、公司拟采取的风险控制措施

1、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，确保不影响日常经营活动的所需资金。

2、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。

3、公司将严格按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》及《企业会计准则第 24 号—套期保值》相关规定执行，合理进行会计处理工作。

4、公司将严格按照《期货套期保值内部控制制度》安排和使用境内期货从业人员、风险管理员，加强相关人员的职业道德教育及业培训，提高相关人员的综合素质。

5、公司将设立符合要求的计算机系统及相关设施，选配多条通道，降低技术风险。

五、对公司的影响

公司使用自有资金开展套期保值业务有利于提高公司资金的使用效率，有效降低原材料价格波动而带来的经营风险，保证公司主营业务健康、稳定增长。

六、决策程序

根据《深圳证券交易所股票上市规则》和《公司章程》等相关规定，公司开展套期保值业务经公司董事会审议通过，并经公司独立董事发表相关意见。该事项在董事会决策权限内，无须提交公司股东大会审议批准。同时授权公司董事长或相关授权人士在上述范围内签署相关法律文件，公司管理层具体实施相关事宜。

七、独立董事意见

公司开展套期保值业务有利于规避原材料价格波动带来的市场风险，降低经营风险，具有一定的必要性，不存在损害公司及全体股东尤其是中小股东利益的情形。该事项决策审批程序符合相关法律、行政法规、规范性文件及《公司章程》的有关规定。

因此，我们一致同意公司使用额度不超过 20,000 万元的自有资金开展套期保值业务。自董事会审议通过之日起一年内有效。

八、备查文件

1、第五届董事会第三次会议决议；

2、公司独立董事的独立意见。

特此公告。

上海摩恩电气股份有限公司董事会
二〇二〇年十月三十日