

证券简称：新金路

证券代码：000510

编号：临 2022—08 号

四川新金路集团股份有限公司 关于下属子公司 2022 年度开展 PVC 期货 套期保值业务的公告

本公司及董事局全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏

重要内容提示：

（一）四川新金路集团股份有限公司（以下简称“公司”）下属全资子公司四川旌路产业（集团）供应链有限公司（以下简称“旌路公司”）拟在大连商品交易所开展PVC期货套期保值业务。

（二）本次期货套期保值业务拟投入的保证金不超过人民币3,000万元（保证金不包括期货交易盈利资金）。

（三）此次开展PVC期货套期保值业务，是为了规避和减少PVC市场价格波动给公司带来的经营风险，确保公司稳健发展，但在实施过程中也可能存在流动性风险、操作风险等风险，公司将积极落实各项风险控制措施，防范风险。

公司为氯碱化工生产企业，PVC树脂为公司主导产品，公司下属全资子公司旌路公司主要开展相关供应链贸易经营业务，为充分利用期货套期保值工具来规避和减少PVC市场价格波动给公司带来的经营风险，确保公司稳健发展，结合旌路公司业务发展的实际情况，公司董事会审议同意旌路公司在2022年度开展PVC期货套期保值业务，具体情况如下：

一、PVC 期货套期保值业务概述

（一）目的及必要性

旌路公司围绕“煤炭-兰炭-电石-PVC”塑化产业开展供应链业务，PVC

现货是公司主要产品，为规避现货市场的价格波动给企业带来了经营风险，锁定预期利润或减少现货价格大幅下跌可能造成的损失，增加企业经营的稳定性，旌路公司拟在2022年度开展PVC期货套期保值业务。

（二）投入资金

本次套期保值业务投入的保证金不超过人民币3,000万元（保证金不包括期货交易盈利资金），业务期限内可循环使用。

（三）交易方式：本次套期保值业务仅限于在大连商品交易所进行场内交易，风险等级较低。本次拟开展的期货套期保值业务主要条款如下：

1. 交易品种：仅限于境内期货交易所交易的PVC商品期货品种。
2. 交易数量：PVC套期保值根据经营需要期现按100%比率进行套期保值。保值实施滚动操作，全年任意时点保值量不超过保值比例上限。
3. 金额：套期保值业务保证金不超过人民币3,000万元（保证金不包括期货交易盈利资金）。
4. 合约期限：不超过12个月。
5. 履约担保：以期货交易保证金方式担保。
6. 交易杠杆倍数：10倍以内（含）。
7. 流动性安排和清算交易原则：根据建立头寸所对应的每日结算价进行资金方面的准备，并按照期货交易所相应的结算价格或开平仓价格进行清算。
8. 支付方式及违约责任：出现违约或者交易损失，按现金汇付结算。

（四）套期保值业务授权期限：自公司本次董事会审议通过之日起12个月内。

（五）资金来源：自有资金，不涉及使用募集资金或银行信贷资金。

二、本次套期保值业务的审议程序

本次套期保值业务事项不属于关联交易事项，已经公司2022年第二次临时董事局会议审议通过，根据深圳证券交易所《股票上市规则》及《公

司章程》等相关规定，无需提交公司股东大会审议。

三、本次套期保值业务的风险分析及风控措施

（一）风险分析

公司开展套期保值业务，以从事套期保值为原则，不以套利、投机为目的，主要是用来规避现货交易中价格波动所带来的经营风险，但在实施过程中也可能存在以下风险：

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. 流动性风险：可能因成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

3. 内部控制风险：套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，并不是简单的买或卖，可能会产生由于内控风控体系不完善而导致的风险。

4. 资金风险：如投入金额过大，可能造成企业资金流动性风险。

5. 操作技术风险：可能因为计算机系统不完备或由于错误、不完善的操作造成错单而给公司带来损失。

（二）风控措施

1. 将套期保值业务与公司经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。期货持仓量不超过对应合约期内公司正常经营时的最大现货产量，持仓时间应与现货保值所需的计价期相匹配。

2. 合理选择期货保值月份；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. 合理计划和安排使用保证金，保证套期保值过程正常进行；套期保值业务具体操作人每日密切关注套期保值头寸持仓风险，按照期货交易所及期货公司、大宗交易的要求及时做好保证金的追加工作。当可能出现由于保证金不足将被强行平仓的情况时，启动快速决策机制，直接调拨资金追加保证金。

4. 严格按照《期货套期保值管理制度》等相关规定，合理设置套期保

值业务组织机构，完善岗位责任制，明确各自职责权限，加强风控体系建设及监督，及时识别内部控制缺陷并采取相应补救措施。

5. 建立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，保证交易系统正常运行。

四、开展套期保值业务对公司的影响

（一）对公司经营的影响

PVC是公司经营的主导产品，此次开展套期保值业务，以从事套期保值为原则，不以套利、投机为目的，可充分利用期货市场的套期保值功能，规避和减少PVC市场价格波动给公司带来的经营风险，锁定预期利润或减少现货价格大幅下跌可能造成的损失，增加企业经营的稳定性，确保公司的稳健发展。

（二）拟采用的会计政策及核算原则

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》等规定，对套期保值业务进行相应的会计处理，公司套期保值业务所选择的交易所和交易品种市场透明度大，成交活跃，流动性较强，成交价格和结算价能充分反映衍生品的公允价值。

五、套期保值业务后续信息披露

（一）当套期保值业务导致合计亏损或者浮动亏损金额达到公司最近一年经审计的归属于上市公司股东净利润的10%且绝对金额超过1,000万元人民币的，公司将及时披露。

（二）公司将在定期报告中对已开展的套期保值业务相关信息予以披露。

六、独立董事意见

公司独立董事认为：此次开展PVC期货套期保值业务，以具体经营业务为依托，在保证正常生产经营的前提下，运用套期保值工具来提高公司抵御市场波动和平抑价格震荡的能力，对冲价格波动对公司生产经营的影

响，不存在损害公司和全体股东利益的情形。公司建有《期货套期保值管理制度》及相关实施细则，就公司开展PVC期货套期保值业务的行为明确了审批流程及风险控制措施，该事项审议和决策程序符合有关法律、法规以及《公司章程》的规定，我们同意该事项。

七、备查文件

（一）公司 2022 年第二次临时董事局会议决议。

（二）公司独立董事意见书面文件。

（三）公司套期保值可行性分析报告。

特此公告

四川新金路集团股份有限公司董事局

二〇二二年三月二十六日