

证券代码：300226

证券简称：上海钢联

公告编号：2023-036

上海钢联电子商务股份有限公司

关于公司2022年度衍生品投资的专项说明

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据《深圳证券交易所创业板上市公司自律监管指南第 1 号——业务办理》《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 2 号——创业板上市公司规范运作》等有关规定的要求，上海钢联电子商务股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对 2022 年度衍生品交易情况进行了核查，现将相关情况说明如下：

一、衍生品投资审议情况

1、商品套期保值

公司于 2022 年 4 月 13 日召开的第五届董事会第十八次会议审议通过了《关于钢银电商及其下属公司继续开展套期保值业务的议案》，根据公司套期保值制度的规定，结合公司业务，同意公司控股子公司上海钢银电子商务股份有限公司（以下简称“钢银电商”）、钢银电商子公司上海铁炬机械设备有限公司（以下简称“上海铁炬”）、上海闪达实业有限公司（以下简称“闪达实业”）、上海九重金供应链管理有限公司（以下简称“九重金”）及其子公司上海苏博九重金新材料科技有限公司（以下简称“苏博九重金”）使用保证金不超过人民币 6,000 万元（持仓量：钢银电商及其下属公司最高持仓量不超过 80,000 吨，且各自期货持仓量原则上应不超过各自自有库存量）开展期货套期保值业务，有效期至本次股东大会审议通过之日起一年。

2、外汇套期保值

公司于 2022 年 4 月 13 日召开的第五届董事会第十八次会议审议通过了《关于钢银电商及其下属公司继续开展外汇套期保值业务的议案》，同意公司控股子公司钢银电商的全资子公司上海钢银供应链管理有限公司（以下简称“钢银供应链”）、孙公司钢银供应链管理（香港）有限公司（以下简称“钢银供应链香港

公司”)开展余额不超过 1,000 万美元或等额外币额度的远期外汇套期保值交易，有效期至本次股东大会审议通过之日起一年。

二、2022 年衍生品交易情况

单位：万元

衍生品投资类型	初始投资金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	报告期内购入金额	报告期内售出金额	期末金额	期末投资金额占公司报告期末净资产比例
钢材套期保值	2,440.84	241.10	0	19,829.68	20,641.23	1,629.29	0.93%
合计	2,440.84	241.10	0	19,829.68	20,641.23	1,629.29	0.93%
报告期实际损益情况的说明	为规避和防范主要钢材价格波动给公司带来的经营风险，公司按照一定比例，针对公司生产经营相关库存钢材开展套期保值业务，业务规模均在预计的采购、销售业务规模内，具备明确的业务基础。报告期内，公司商品套期保值衍生品合约和现货盈亏相抵后的实际收益金额合计为 1,546.62 万元。						
套期保值效果的说明	公司从事套期保值业务的金融衍生品和商品期货品种与公司生产经营相关钢材产品相挂钩，可抵消现货市场交易中存在的价格风险的交易活动，实现了预期风险管理目标						

注：1、2022 年度，钢银电商及下属子公司开展套期保值业务最高保证金余额为 2,297.95 万元，最高持仓量为 4,726 吨，在公司董事会审议的额度范围内。

2、公司在 2022 年度未开展外汇套期保值业务。

三、内控制度执行情况

公司已制定《套期保值业务管理制度》《外汇套期保值业务管理制度》等，规范公司外汇套期保值及商品套期保值行为，明确相关内部决策程序、业务操作流程、风险控制措施等，能有效防范风险。2022 年度，公司严格按照上述制度相关规定开展套期保值业务，未有违反相关法律法规及规范性文件规定之情形。

四、独立董事意见

公司独立董事发表了独立意见：2022 年度，公司严格按照相关法律法规、《公司章程》及相关内控制度的要求开展衍生品交易，履行了相应的决策程序，未出现违反相关法律法规及规章制度的行为，不存在损害公司及股东利益的情形。我们对此一致表示同意。

五、监事会意见

公司监事会认为：2022 年度，公司开展的衍生品交易严格遵循《公司章程》及相关内控制度的规定，不存在违反法律法规及规范性文件规定的情形。

六、备查文件

- 1、公司第五届董事会第二十五次会议决议；
- 2、公司第五届监事会第二十二次会议决议；
- 3、独立董事对第五届董事会第二十五次会议相关事项的专项说明与独立意见。

特此公告。

上海钢联电子商务股份有限公司

董事会

2023 年 4 月 14 日