

思源电气股份有限公司关于开展铜期货套期保值业务的公告

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。

2023年6月9日，思源电气股份有限公司（下称“公司”）第八届董事会第一次会议审议通过了《关于开展铜期货套期保值业务的决议》，根据公司《商品期货套期保值业务管理制度》，同意公司使用自有资金开展铜期货套期保值业务，业务期间为自本次董事会审议通过之日起至2024年6月30日止，公司业务期间占用期货保证金余额不超过人民币5,000万元（含5,000万元，但不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内）。现就相关事项公告如下：

一、套期保值业务情况概述

1.1、目的和必要性：公司主营业务为输配电设备的研发、生产、销售及服务，铜材是主要原材料之一。为防范铜材的价格波动，减少对成本造成的影响，公司开展铜期货套期保值业务，主要是为了锁定公司产品成本，有效地防范和化解由于铜材价格变动带来的成本波动，保障利润的实现。

1.2、投资金额：公司业务期间占用期货保证金余额不超过人民币5,000万元（含5,000万元，但不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内）。

1.3、投资方式：公司开展的期货套期保值业务仅限于境内期货交易所挂牌交易的铜期货合约。

1.4、投资期限：自本次董事会审议通过之日起至2024年6月30日止。

1.5、资金来源：公司自有资金。

1.6、实施流程：由公司董事会授权公司期货领导小组作为管理公司期货套期保值业务的领导机构，并按照公司建立的《商品期货套期保值业务管理制度》相关规定及流程进行操作。

二、审议程序

2023年6月9日，公司第八届董事会第一次会议审议通过了《关于开展铜期货套期保值业务的决议》，公司独立董事对本事项发表了同意的独立意见。本事项在董事会审议范围内，无需提交股东大会审议批准。本事项不构成关联交易。

三、套期保值业务的风险分析和风险防控措施

3.1、套期保值业务的风险

公司进行期货套期保值业务存在价格波动、资金、内部控制、技术、政策等方面的风险，具体如下：

3.1.1、价格波动风险：当期货行情大幅剧烈波动时，公司可能无法在要求锁定的价格买入套保或在预定的价格平仓，造成损失。

3.1.2、资金风险：期货交易按照公司《商品期货套期保值业务管理制度》中规定权限下达操作指令，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，此外，在期货价格波动巨大时，公司甚至可能存在未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失的风险。

3.1.3、内部控制风险：期货交易专业性较强，可能会由于内控制度不完善造成风险。

3.1.4、技术风险：由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题。

3.1.5、政策风险：期货市场法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来的风险。

3.2、风险控制措施

3.2.1、公司将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲原材料价格波动风险。公司的期货套期保值业务只限于在境内的期货交易所交易的铜期货合约，严禁进行以逐利为目的的任何投机交易。

3.2.2、公司严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。公司业务期间占用期货保证金余额不超过人民币5,000万元（含5,000万元，但不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内）。公司将合理调度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。

3.2.3、公司根据有关规定，结合公司实际情况，制定了《商品期货套期保值业务管理

制度》，对套期保值业务额度、品种范围、审批权限、内部审核流程、责任部门及责任人、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等作出明确规定。公司将严格按照《商品期货套期保值业务管理制度》的规定，对各个环节进行控制。

3.2.4、公司设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。

3.2.5、公司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。

四、开展套期保值业务对公司的影响

4.1、公司套期保值交易品种为国内主要期货市场主流品种，市场透明度高，成交活跃，成交价格和当日结算单价能充分反映衍生品的公允价值。

4.2、公司套期保值交易的相关会计政策及核算原则按照财政部发布的《企业会计准则—金融工具确认和计量》及《企业会计准则—套期会计》相关规定执行。

4.3、公司进行的铜期货套期保值业务遵循的是锁定原材料价格风险、套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作。公司在签订套期保值合约及平仓时进行严格的风险控制：依据自身经营规模锁定原材料价格和数量情况，使用自有资金适时购入相应的期货合约；在现货采购合同生效时，做相应数量的期货平仓。期货套期保值业务一定程度上可以规避材料价格波动对公司的影响。

4.4、鉴于套期保值业务的开展具有一定的风险，对公司的影响具有不确定性，敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。

五、独立董事意见

5.1、公司在保障正常运营和资金安全的基础上，开展铜期货套期保值业务的相关审批程序符合相关法律、法规及《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》、《公司章程》的有关规定。

5.2、公司已制定了《商品期货套期保值业务管理制度》，对开展期货套期保值业务的目的、组织机构、审批及权限、业务流程、风险控制、报告制度、信息披露、档案管理、保密制度等方面做出了明确规定，有利于加强期货套期保值业务的风险管理和控制。

5.3、公司结合生产原材料采购情况，使用自有资金开展套期保值业务，符合公司生产经营需求，有利于降低铜材价格波动对成本的影响，不存在损害公司和股东特别是中小股东利益的情形。综上，我们一致同意公司本次开展铜期货套期保值业务。

六、备查文件

6.1、第八届董事会第一次会议决议；

6.2、独立董事关于公司第八届董事会第一次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

思源电气股份有限公司董事会

二〇二三年六月九日