

深圳市汇川技术股份有限公司

关于调整子公司商品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、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

深圳市汇川技术股份有限公司（以下简称“公司”）于2020年11月12日召开第四届董事会第三十一次会议，审议通过了《关于调整子公司商品期货套期保值业务的议案》，现将相关情况公告如下：

一、商品期货套期保值业务概述

公司于2020年8月14日召开第四届董事会第二十六次会议，审议通过了《关于子公司开展商品期货套期保值业务的议案》，同意公司全资子公司上海贝思特电气有限公司（含其下属公司，以下简称“贝思特”）在不超过人民币6,000万元日余额额度内开展铜、聚氯乙烯期货套期保值业务，该额度自董事会审议通过后一年内有效。具体内容请查阅公司在巨潮资讯网上披露的公告：《关于子公司开展商品期货套期保值业务的公告》（公告编号：2020-062）。

因公司全资子公司苏州汇川技术有限公司（以下简称“苏州汇川”）、苏州汇川联合动力系统有限公司（以下简称“联合动力”）有铜、铝、银期货套期保值需求，公司于2020年11月12日召开第四届董事会第三十一次会议，审议通过了《关于调整子公司商品期货套期保值业务的议案》，同意公司对商品期货套期保值业务作出如下调整：①新增商品期货套期保值业务实施主体苏州汇川、联合动力；②新增交易品种铝和银；③将商品期货套期保值业务日余额额度由不超过人民币6,000万元增加为不超过3亿元（含本数，下同）。调整后，开展商品期货套期保值业务的实施主体变更为贝思特（含其下属公司）、苏州汇川、联合动力，交易品种变更为铜、聚氯乙烯、铝和银，额度变更为日余额额度不超过3亿元。。该额度自本次董事会审议通过后一年内有效。已经第四届董事会第二十六次会议

审议通过且仍在有效期内的期货套期保值业务额度不再使用。

公司独立董事就该事项发表了明确的同意意见。本次对子公司商品期货套期保值业务进行调整在公司董事会权限范围内，无需提交股东大会审议。

二、商品期货套期保值业务的目的

贝思特主要原材料是铜、聚氯乙烯等产品，苏州汇川、联合动力的原材料含铜、铝、银等产品，原材料产品价格受国际市场的影响较大。为促进公司业务稳健开展，规避原材料价格波动带来的经营风险，控制生产成本，贝思特、苏州汇川、联合动力拟开展铜、聚氯乙烯、铝、银套期保值业务。

三、开展商品期货套期保值业务的基本情况

1、交易品种

贝思特、苏州汇川、联合动力开展的期货套期保值业务将只限于在场内市场交易的铜、聚氯乙烯、铝、银期货品种，严禁进行以逐利为目的的任何投机交易。

2、额度及期限

根据实际业务需要，贝思特、苏州汇川及联合动力在不超过人民币3亿元日余额额度内以自有资金开展商品期货套期保值业务，该额度自本次董事会审议通过一年后有效。

3、会计政策及核算原则

公司根据财政部《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》(财会【2017】7号)、《企业会计准则第23号——金融资产转移》(财会【2017】8号)、《企业会计准则第24号——套期会计》(财会【2017】9号)及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(财会【2017】14号)相关规定及其指南，对拟开展的商品期货套期保值业务进行相应的核算处理。

四、开展期货套期保值业务的风险分析

商品期货套期保值业务以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，是为了锁定原材料价格波动的风险，不做投机和套利交易。但是开展商品期货套期保值业务也会存在一定的风险：

1、价格波动风险：当期货行情变动较大时，公司可能无法在要求锁定的价

格买入、卖出套保或在预定的价格平仓，造成损失。

2、资金风险：期货套期保值交易采取保证金和逐日盯市制度。可能会带来资金流动性风险以及未及时补足保证金被强制平仓而产生损失的风险。

3、内部控制风险：期货套期保值交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成的风险。

4、技术风险：从交易到资金设置、风险控制，到与期货公司的链路，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。

5、客户违约风险：在产品交付周期内，由于原材料价格周期大幅波动，客户主动违约而造成公司期货交易上的损失。

五、公司采取的风险控制措施

1、公司制定了《期货套期保值业务管理制度》，利用事前、事中及事后的风险控制措施，预防、发现和降低各种风险。该制度符合监管部门的有关要求，满足实际操作的需要，所制定的风险控制措施切实有效。

2、将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险：公司期货套期保值业务只限于在境内期货交易所交易的期货。期货持仓量不超过套期保值的现货需求量，持仓时间应与现货保值所需的计价期相匹配。

3、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，严格按照公司管理制度中规定的权限下达操作指令，根据规定进行审批后，方可进行操作。

4、公司财经管理部、内部审计部、各子公司作为相关责任部门或单位均有清晰的管理定位和职责，通过分级管理，形成监督机制，从根本上杜绝了单人或单独部门操作的风险，在有效地控制风险的前提下也提高了对风险的应对速度。

5、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。当发生错单时，及时采取相应处理措施，减少损失。

6、公司将建立客户的信用管理体系，在交易前对交易对方进行资信审查，确定交易对方有能力履行相关合同。

六、独立董事意见

公司此次对子公司商品期货套期保值业务进行调整,增加了实施商品期货套期保值业务的子公司、交易品种、以及交易额度,系基于公司正常生产经营的需要,能进一步充分利用期货市场的套期保值功能,规避原材料价格大幅波动可能给公司经营带来的不利影响。同时,公司已建立了《期货套期保值业务管理制度》,完善了审批权限和内部操作流程。我们认为,公司此次对子公司商品期货套期保值业务进行调整符合公司业务发展需求, 审议程序合法合规,不存在损害公司股东的利益的情形。因此,我们同意公司此次对子公司商品期货套期保值业务进行调整。

七、监事会意见

公司本次对商品期货套期保值业务相关事项进行调整系为了满足公司正常经营的需要。本次调整履行了相关的审批程序,符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定,不存在损害公司和全体股东利益的情况。公司已制定《期货套期保值业务管理制度》,通过加强内部控制,规范了业务流程,落实了风险防范措施。同意公司子公司贝思特、苏州汇川及联合动力在不超过人民币3亿元日余额额度内以自有资金开展商品期货套期保值业务。

八、备查文件

- 1、第四届董事会第三十一次会议决议;
- 2、第四届监事会第二十五次会议决议;
- 3、独立董事关于第四届董事会第三十一次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

深圳市汇川技术股份有限公司

董事会

二〇二〇年十一月十三日