

证券代码：603848

证券简称：好太太

公告编号：2020-010

## 广东好太太科技集团股份有限公司 关于拟开展期货套期保值业务公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

广东好太太科技集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2020年3月29日召开了第二届董事会第七次会议，审议通过了《关于拟开展期货套期保值业务的议案》。现将相关情况公告如下：

### 一、开展期货套期保值业务目的及必要性

公司生产所需的原材料主要是金属类，其价格走势与上游原材料价格高度关联。为避免原材料价格波动带来的潜在风险，公司拟开展原材料期货套期保值业务，以降低原材料市场价格波动对公司正常生产经营活动的影响。

### 二、开展期货套期保值业务情况

（一）交易品种：与公司生产所需原材料相关的金属。

（二）保证金规模：该业务以套期保值为目的，不进行投机交易，保证金金额不超过人民币6,000万元，占公司最近一期经审计净资产的4.66%（不包括交割当期头寸而支付的全额保证金）。

（三）有效期：自本次董事会审议通过之日起一年内，如在此期间董事会对本事项做出新的决议，则授权期限至董事会重新对本事项作出新的决议之日止。

（四）资金来源：套期保值业务使用公司自有流动资金进行操作，不涉及募集资金。

（五）其他说明：公司套期保值业务尚未确定相关的合作银行及券商。董事会审议通过后，公司会充分关注期货经纪公司选择、资金风险、市场风险等关键环节。

### 三、对公司的影响

公司最近一年（经审计）及最近一期（未经审计）的财务情况如下：

单位：元

	2018年12月31日	2019年9月30日
资产总额	1,630,018,839.42	1,645,818,040.49
负债净额	343,445,687.97	279,501,051.50
资产净额	1,286,573,151.45	1,366,316,988.99
	2018年1-12月	2019年1-9月
经营活动产生的现金流量净额	285,010,146.61	59,137,386.97

公司坚持规范运作，防范风险，以对现货保值为目的，为避免原材料价格波动带来的潜在风险，开展原材料期货套期保值业务，以降低原材料市场价格波动对公司正常生产经营活动的影响，提升市场竞争力。

#### 四、期货套期保值的风险分析

公司进行期货套期保值业务以对现货保值为目的，主要为有效规避原材料及产品价格波动对公司带来的不利影响，但同时也会存在一定的风险：

（一）价格波动风险：套期保值之所以能降低企业因价格变动导致的损失，其基础是建立在套保工具与被套保项目的价格呈相同的变化趋势，而以相反的操作对冲，以平滑效益。然而，当市场出现变化时，例如现化市场价格发生重大变化、或突发变化趋势或任何一方大幅波动时，会导致两者的盈亏不但无法对冲，反而会增加亏损。

（二）政策风险：期货市场的法律法规等相关政策发生重大变化，从而导致期货市场发生剧烈变动或无法交易的风险。

（三）流动性风险：如果合约活跃度较低，导致套期保值持仓无法在合适的价位成交，令实际交易结果与方案设计出现较大偏差，从而带来损失。

（四）操作风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，存在操作不当或操作失败的可能，从而带来相应风险。

（五）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的风险。

（六）技术风险：从交易到资金设置、风险控制，再到与期货公司、场外期权交易对手的联络，内部系统的稳定与交易的匹配等，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。

## 五、公司采取的风险控制措施

（一）公司制定了《期货套期保值业务管理制度》，明确了开展套期保值业务的组织机构及职责、业务授权及操作流程、风险管理等内容，通过严格的内部控制指导和规范执行，形成较为完整的风险控制体系。

（二）严守套期保值原则，杜绝投机交易。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。

（三）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。

（四）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。

（五）严格遵守商品期货交易所相关规定，积极配合交易所及期货公司相关部门的风险管理工作。

（六）设立专门的风险控制岗位，强化内控制度的落实，加强对相关业务人员的专业培训，提高套期保值从业人员的综合素养；

（七）定期进行内部审计，以有效防范风险。

## 六、独立董事意见

公司独立董事关于公司开展期货套期保值业务，发表如下意见：

公司开展原材料期货套期保值业务，通过套期保值的避险机制可减少因原材料价格波动造成的产品成本波动给公司生产经营带来的不利影响，保证产品成本的相对稳定，进而维护公司正常生产经营活动，提高公司抵御市场波动和平抑价格震荡的能力。公司已制定《期货套期保值业务管理制度》，加强内部控制，落实了风险防范措施。公司开展原材料期货套期保值业务是可行的，公司开展期货套期保值业务的相关审批程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，不存在损害公司及全体股东利益的情形。因此，我们同意公司开展原材料期货套期保值业务。

特此公告。

广东好太太科技集团股份有限公司董事会

2020年3月30日