

史丹利农业集团股份有限公司

关于公司 2022 年度开展期货套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告的内容真实、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：

1、投资种类：史丹利农业集团股份有限公司（以下简称“公司”）开展的期货套期保值业务主要是以与生产经营相关的原材料—尿素作为套期保值的期货品种。

2、投资金额：投入保证金最高余额不超过人民币1,000.00万元（不含期货标的实物交割款项），期限自董事会审议通过之日起一年，期限内任一时点的保证金余额不超过该额度。

3、特别风险提示：公司开展尿素期货套期保值业务可以降低原材料价格波动对公司生产经营的影响，但也存在基差风险、逐日结算风险、投机风险、内控风险、政策性风险等系统和非系统性风险。

一、开展套期保值业务的概况

1、投资目的：尿素为公司日常生产经营所需的原材料，公司在淡旺季均储备数量不等的尿素原料库存。为规避尿素价格波动带来的市场风险，降低经营风险，锁定原材料成本，公司拟开展尿素期货套期保值业务。

2、投资金额和期限：投入保证金最高余额不超过人民币 1,000.00 万元（不含期货标的实物交割款项），期限自董事会审议通过之日起一年，期限内任一时点的保证金余额不超过该额度。

3、投资方式：通过郑州商品交易所挂牌交易的尿素期货合约进行套期保值

4、资金来源：自有资金

二、审议程序

本次公司开展套期保值业务已经2022年4月19日召开的公司第五届董事会第十一次会议审议通过，额度在董事会的审批权限内，无需提交股东大会审议，独立董事发表了独立意见。本次公司开展套期保值业务不涉及关联交易。

三、期货套期保值的风险分析及风控措施

1、公司开展期货套期保值业务可以降低原材料价格波动对公司生产经营的不利影响，但也存在一定的风险。套期保值业务主要风险有：

(1) 基差风险：指期货与现货之间价格波动不同步所带来的风险。套期保值交易的效果经常受基差变动影响，理论上随着到期日的接近，现货价格与期货价格将趋于一致，但如果套保期与期货合约到期日不完全一致，或到期日时，期货与现货价格不完全一致，则存在基差风险，从而影响套期保值的效果。

(2) 逐日结算风险：由于期货交易实行保证金交易和逐日结算制度，如果出现不利变动，可能被要求补足保证金到规定的额度。如资金周转不足，可能出现无法补足保证金而被强行平仓的风险。

(3) 投机风险：期货交易有时可以带来相当的收益，在开展套期保值业务过程中，可能会发生不严格执行套期保值方案，而进行投机交易的风险。

(4) 内控风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，会有因内控体系不完善而产生的风险。

(5) 系统性风险：由于政治、经济、社会、环境、技术等因素对期货交易造成的不利影响

2、公司采取的风险控制措施：

(1) 公司将期货套期保值业务与公司生产经营情况相匹配，期货套期保值业务仅以规避生产经营中所需原材料的价格波动为目的，不涉及投机和套利交易，同时公司期货套期保值品种只限于在境内期货交易所交易的公司生产经营中所需要的原材料，套期保值头寸数量不超过实际现货交易的数量，期货持仓量不超过套期保值现货量。

(2) 严格控制套期保值的资金规模，合理使用保证金，严格按照公司《期货套期保值管理制度》的规定开展期货套期保值业务。

(3) 根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第1号—主板上市公司规范运作》、《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第7号—交易与关联交易》等有关规定，保证本次套期保值业务以公司或子公司的名义设立套期保值交易账户，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。

(4) 公司已制定了《期货套期保值管理制度》和具体的管理细则，对套期保值额度、品种、审批权限、内部操作流程、责任部门及责任人、风险管理制度、报告制度、保密制度、信息披露、档案管理制度等作出了明确规定。公司设立了专门的风险控制岗位，实行授权和岗位牵制。公司将严格按照规定，安排和使用

专业人员，建立严格的授权和岗位牵制制度，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。同时建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序。

(5) 设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展，当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。

四、开展期货套期保值业务对公司的影响

公司开展期货套期保值业务仅限于尿素品种，目的是借助期货市场的价格发现、风险对冲功能，利用套期保值工具规避市场价格波动风险，保证公司经营业绩的稳定性，不做投机性交易，不会影响公司主营业务的正常发展。

公司将严格按照财政部发布的《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》、《企业会计准则第37号—金融工具列报》等相关规定执行，对开展的期货套期保值业务进行相应的核算处理。

五、独立董事意见

经核查，独立董事发表独立意见如下：公司开展期货套期保值业务的审批符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，同时，公司制定了《期货套期保值管理制度》，能够有效进行内部控制和管理，落实风险防控措施。在保证正常生产经营的前提下，公司开展尿素期货套期保值业务，有利于对冲原材料价格波动对公司生产经营的影响，有助于公司稳健经营。因此，独立董事同意公司开展尿素期货套期保值业务，投入保证金最高余额不超过人民币1,000.00万元（不含期货标的实物交割款项），期限自董事会审议通过之日起一年。

六、备查文件

- 1、公司第五届董事会第十一次会议决议；
- 2、独立董事关于第五届董事会第十一次会议及2021年年度报告相关事项的独立意见。

特此公告。

史丹利农业集团股份有限公司董事会

二〇二二年四月二十日