

## **东方集团股份有限公司**

### **关于预计衍生品交易额度的公告**

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。

东方集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2022年4月29日召开第十届董事会第二十一次会议，审议通过了《关于预计衍生品交易额度的议案》，同意授权公司所属子公司在2022年度使用不超过2.5亿元自有资金开展商品期货套期保值业务，有效期自董事会审议通过之日起不超过12个月，在董事会决议有效期内可在上述额度内滚动使用。现将有关情况公告如下：

#### **一、衍生品交易概述**

##### **1、衍生品交易品种及交易场所**

为减少农产品价格波动造成的损失，公司子公司东方粮仓有限公司（以下简称“东方粮仓”）及其所属公司开展菜油、菜粕、豆油、豆粕、玉米、大豆、水稻、普通圆粒大米等品种的期货套期保值业务。上述交易主要在境内期货交易所进行，如需境外市场操作通过有经纪业务资质的证券公司进行。

##### **2、业务规模及资金来源**

东方粮仓及其所属子公司拟使用不超过2.5亿元自有资金开展期货套期保值业务，在额度范围内可以滚动使用。

#### **二、开展衍生品交易的目的和必要性**

东方粮仓为公司核心主营现代农业及健康食品产业经营主体，东方粮仓及其所属公司经营业务包括大米加工销售、油脂及豆制品加工销售、其他农产品购销业务等，开展期货套期保值业务的目的是充分利用期货市场的套期保值功能，减少因原材料和产成品价格波动造成的损失，其从事套期保值交易的品种必须与其所经营的商品或采购原材料品种相符。

#### **三、开展衍生品交易的风险分析**

1、市场风险：存在因价格波动，期货与现货的价格严重背离，从而无法达到规避价格波动的风险，且由此可能产生额外的利润或者亏损。

2、流动性风险：存在因交易合约缺乏流动性，导致无法及时以合理的价格平仓的风险。

3、资金风险：存在因行情急剧变化，可能导致未能及时补充保证金而被迫平仓的风险。

4、操作风险：相关期货业务工作人员未按照规定程序进行套期保值操作的风险。

#### **四、风险应对策略**

公司制定《东方集团股份有限公司期货套期保值业务管理制度（2021年12月修订）》，严格控制期货套期保值交易风险。

1、公司设立期货企业领导小组负责期货套期保值的整体决策，成员包括公司董事长、总裁、分管业务副总裁、财务总监，开展期货套期保值业务相关子公司董事长/总裁，期货业务领导小组对期货套期保值业务风险进行全面控制。

2、公司建立风险测算系统应对保值头寸价格变动风险和资金风险。建立内部风险报告制度，当期货市场价格波动较大或发生异常波动的情况时，交易员应立即报告期货业务领导小组。

3、合理计划和安排使用保证金，保证套期保值过程正常进行。合理选择保值月份，避免市场流动性风险。期货业务领导小组按照不同月份的实际经营情况来确定和控制当期的套期保值量，不得超过公司董事会授权范围进行保值。

4、审慎选择期货经纪公司，合理设置期货业务组织机构和选聘期货业务人员，严格按照规定安排和使用期货专业人士、风险管理员，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。

5、加强内部审计监督检查，公司相关部门有权采用定期或不定期的方式，对东方粮仓及其子公司开展的套期保值业务进行检查，并将检查结果向公司董事会报告。

#### **五、独立董事关于预计衍生品交易额度的独立意见**

公司在正常生产经营基础上开展与主营业务相关的原材料及产成品期货套期保值业务，有利于利用衍生工具减少价格波动风险。公司已建立《东方集团股份有限公司期货套期保值管理制度》，并对期货套期保值交易限额、品种、操作流程、风险控制等进行规定，建立了相应的监管机制避免风险，公司从事期货套期保值业务风险可控，

董事会审议程序符合有关法律、法规以及公司《章程》的规定，不存在损害公司及股东利益的情形。我们同意公司所属子公司在额度范围内开展期货套期保值业务。

特此公告。

东方集团股份有限公司董事会

2022年4月30日