

长飞光纤光缆股份有限公司

关于公司及下属公司 2024 年度开展原材料期货及 衍生品套期保值交易业务的公告

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法律责任。

重要内容提示：

- 交易信息：长飞光纤光缆股份有限公司（以下简称“公司”、“本公司”）及下属公司拟开展电力线缆生产所需原材料铜和铅的期货及衍生品套期保值交易业务，包括铜和铅的期货及期权等相关组合产品交易。
- 交易目的：为规避铜和铅市场价格波动风险，仅以套期保值为目的开展套期保值交易。
- 交易金额：公司及下属公司拟开展的原材料期货及衍生品套期保值交易业务额度为人民币10亿元、套期保值保证金额度为人民币2亿元。额度使用期限自董事会审议批准之日起至2025年3月31日。
- 已履行的审议程序：该事项已经公司于2024年10月30日召开的第四届董事会审计委员会2024年第四次会议，及公司第四届董事会第十次会议审议通过。
- 特别风险提示：公司及下属公司开展套期保值业务基于日常生产经营所需，不以投机为目的。但相关套期保值业务无本金或收益保证，在交易过程中存在市场风险、流动性风险、履约风险、操作风险、技术风险、政策风险等相关风险，敬请广大投资者注意投资风险。

一、交易业务情况概述

1、交易目的

宝胜（扬州）海洋工程电缆有限公司、武汉长飞通用电缆有限公司、安弗施无线射频系统（苏州）有限公司等公司下属公司均从事电力线缆生产相关业务，而铜与铅为生产所需主要原材料。为有效降低该等原材料价格波动对生产成本造成的影响，提升相关业务抵御风险的能力，公司及下属公司拟开展基于日常生产

经营所需的套期保值业务。该等套期保值业务与日常生产经营紧密相关，存在明确的风险对冲关系，以套期保值为原则，能降低相关原材料价格风险敞口，不存在投机性操作，符合公司及相关下属公司生产经营的需要。

2、交易金额及期限

公司及下属公司拟开展的原材料期货及衍生品套期保值交易业务额度为人民币 10 亿元、套期保值保证金额度为人民币 2 亿元。额度使用期限自公司第四届董事会第十次会议审议批准之日起至 2025 年 3 月 31 日。上述额度在期限内可循环滚动使用，但期限内任一时点的套期保值原材料总价值不超过人民币 10 亿元、且用于相关套期保值工具的保证金占用不得超过人民币 2 亿元。

3、交易方式及类型

公司及下属公司拟开展的原材料期货及衍生品套期保值交易业务只限于生产经营所需的铜与铅商品，交易对手方为具有期货及衍生品交易业务经营资格、经营稳健且资信良好的国内和国际性金融机构。进行的原材料期货及衍生品交易业务工具具体包括期货及期权等相关组合产品。

4、交易资金来源

公司及下属公司拟开展的原材料期货及衍生品套期保值交易业务资金来源为公司自有资金，不涉及使用募集资金。

二、公司履行的决策程序

公司于 2024 年 10 月 30 日召开第四届董事会第十次会议，以同意 12 票、反对 0 票、弃权 0 票审议通过了《关于公司及下属公司 2024 年度开展原材料期货及衍生品套期保值交易业务的议案》，同意公司开展原材料期货及衍生品套期保值交易业务，并授权管理层具体实施。本议案已经公司第四届董事会审计委员会 2024 年第四次会议审议通过。本议案无需提交公司股东大会审议批准。

三、交易业务风险分析及风险控制措施

（一）交易业务风险

1、市场风险

期货及衍生品合约价格与相应市场实际价格的差异将引起合约价值变动。该等变动与合约对应的铜与铅大宗商品标的的价值变动形成一定的对冲，但仍有亏损的市场风险。

2、流动性风险

公司及下属公司拟开展的原材料期货及衍生品套期保值交易业务基于公司及下属公司生产经营所需开展,但仍存在因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

3、 履约风险

若原材料期货及衍生品合约交易对手方无法完成交易,则存在履约风险。

4、 操作风险

期货及期权等衍生品交易专业性较强,复杂程度较高,可能会产生操作不当或操作失败的可能,从而带来相应的风险。

5、 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,致使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题,从而带来相应风险。

6、 政策风险

由于国家法律、法规、政策变化以及期货交易所交易规则的修改和紧急措施的出台等原因,从而导致期货市场发生变动或无法交易的风险。

(二) 风险控制措施

1、 公司将持续加强对业务人员的培训,提升专业技能和业务水平,增强风险管理意识。针对政策风险,公司将严格遵守国家相关法律法规的规定,防范法律风险,定期对套期保值业务的规范性、内控机制执行的有效性等方面监督检查;

2、 公司已制定《长飞光纤光缆股份有限公司期货套期保值业务管理制度》以强化风险管理;

3、 公司选择的交易对手方为具有期货及衍生品交易业务经营资格、经营稳健且资信良好的国内和国际性金融机构,并将审慎核查与该等交易对手方签订的合约条款,严格执行风险管理制度。

四、 交易业务对公司的影响

公司及下属公司开展与日常经营需求紧密相关的原材料期货及衍生品套期保值交易业务,有利于降低铜和铅原材料市场价格波动对公司相关业务经营业绩的影响,有利于保障公司资产安全及相关业务长期可持续发展。

公司根据《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》《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》等相关规定及其指南，对套期保值业务进行相应的会计核算，并根据《上海证券交易所股票上市规则》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 5 号——交易与关联交易》等对套期保值业务的相关信息履行披露义务。

特此公告。

备查文件：

- 1、长飞光纤光缆股份有限公司第四届董事会第十次会议决议
- 2、关于开展原材料期货及衍生品交易业务的可行性分析报告
- 3、长飞光纤光缆股份有限公司期货套期保值业务管理制度

长飞光纤光缆股份有限公司董事会

二〇二四年十月三十日