

浙江德创环保科技股份有限公司

关于开展 2024 年度期货套期保值业务的公告

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。

浙江德创环保科技股份有限公司（以下简称“德创环保”、“公司”）于 2024 年 4 月 24 日召开第四届董事会第十九次会议，审议通过了《关于开展 2024 年度期货套期保值业务的议案》，该议案尚需提交 2023 年年度股东大会审议通过。

大宗商品热卷、螺纹钢、不锈钢等（以下合称“钢材”）是公司烟气治理产品生产所需的重要原材料，市场化程度高，价格受市场供求、汇率等各因素的影响，变动较大，如未来原材料价格上涨，将会给公司带来成本和业绩压力；与此同时，公司海外烟气治理业务不断拓展，外汇风险急剧升高。基于以上情况，为规避材料价格、外汇汇率等波动风险，公司拟在 2024 年度对钢材及外汇进行套期保值，具体情况说明如下：

一、2024 年度预计开展的期货套期保值交易情况

单位	套期保值期货品种	预计最高持仓数量	预计最高保证金余额（万元）
德创环保	钢材	10,000 吨	1,250
	外汇	1,000 万美元	1,000

二、套期保值的目

德创环保从事商品、外汇期货交易，目的是充分利用期货市场的套期保值功能，规避经营中使用的材料价格及外汇汇率波动风险，减少因材料价格及外汇波动造成的产品成本波动，保证产品成本的相对稳定，降低材料价格及外汇汇率波动对德创环保正常经营的影响。

三、期货品种

德创环保的期货套期保值业务，只限于从事与德创环保经营所需材料相同的钢材及外汇期货品种。

四、拟投入资金及业务期间

根据产品材料需求测算，2024年度拟对不超过最高持仓数量10,000吨钢材及1,000万美元外汇期货套期保值，预计所需最高保证金余额不超过人民币2,250万元，根据经营情况以及客户订单周期作为期货操作期。

本次授权有效期自2023年度股东大会审议通过之日起至2024年度股东大会审议通过之日止，根据材料需求量进行等值期货套保。

五、套期保值的风险分析

公司进行的期货套期保值业务遵循的是锁定材料价格及外汇汇率风险、套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作，因此在签订套期保值合约及平仓时进行严格的风险控制，依据经营状况以及与客户锁定的材料价格和数量情况，使用自有资金适时购入相应的期货合约，在现货采购合同生效时，做相应数量的期货平仓。

期货套期保值操作一定程度上可以规避材料价格及外汇汇率波动对公司的影响，但同时也会存在一定风险：

1、市场风险：在汇率或利率行情走势与公司预期发生大幅偏离的情况下，公司锁定汇率或利率后支出的成本支出可能超过不锁定时的成本支出，从而造成潜在损失；

2、流动性风险：套期保值策略的实施存在流动性风险，如果内部执行成本很高或者期货市场流动性差，套期保值策略难以执行，将形成敞口暴露在市场风险之下；

3、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；

4、资金风险：期货套期保值交易采取保证金和逐日盯市制度。在期货价格波动巨大时，公司可能存在未及时补充保证金被强行平仓而产生损失的风险；

5、技术风险：由于无法控制或不可预测的系统、网络、通讯故障等原因，导致交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来的相应风险。

6、客户违约风险：期货价格出现不利的大幅波动时，客户可能违反合同的相关约定，取消产品订单，造成公司损失。

7、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风险。

六、公司采取的风险控制措施

1、公司制定了《外汇套期保值业务管理制度》，规定公司不进行单纯以投机为目的的外汇套期保值业务，所有外汇套期保值业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率或利率风险为目的。制度就公司业务操作原则、审批权限、内部审核流程、责任部门及责任人、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等做出了明确规定，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、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，严格按照公司期货交易管理制度规定下达操作指令，根据规定进行审批后，方可进行操作。公司将合理调度资金用于套期保值业务。

3、公司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，并减少损失。

4、根据经营所需及客户订单周期作为期货操作期，降低商品期货价格及外汇汇率波动风险。

5、公司建立风险测算系统对资金风险、保值头寸价格变动风险进行把控；同时建立内部风险报告制度和风险处理程序防范风险。

特此公告。

浙江德创环保科技股份有限公司董事会

2024年4月26日