

## 浙江新安化工集团股份有限公司

### 关于开展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、准确性和完整性依法承担法律责任。

#### 重要内容提示：

- **交易目的、交易品种、交易工具、交易场所：**

鉴于公司工业硅新增产能即将投产，同时为降低公司生产经营相关原材料现货市场价格波动带来的不确定性影响，公司将结合销售和采购计划安排，在保证正常生产经营的前提下，在境内期货交易所和已在中国期货业协会（以下简称“中期协”）、中国证券业协会（以下简称“中证协”）备案的具有场外业务资质的金融机构，开展工业硅等品种的套期保值业务。

- **交易金额：**

公司使用自有资金并结合公司生产经营业务实际情况，在不影响正常经营资金需求和资金安全的前提下，提供套期保值业务任一时点保证金最高占用额不超过人民币6亿元（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）；任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币14亿元。期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过已审议额度。上述额度在有效期内可滚动循环使用。

- **已履行及拟履行的审议程序：**

公司第十一届董事会第十三次会议审议通过了《关于开展套期保值业务的议案》。该事项尚需提交股东大会审议。

- **特别风险提示：**

公司始终遵循稳健原则开展套期保值业务，减少成品和原材料市场价格波动对公司带来的不确定性影响。公司已就套期保值业务制定了内部控制管理制度，持续加强落实风险管理措施，但仍可能存在一定风险，包括但不限于基差风险、操作风险、流动性风险、交易规则风险、技术基础设施风险等，敬请广大投资者注意投资风险。

## 一、交易情况概述

### （一）交易目的

鉴于公司工业硅新增产能即将投产，同时为降低公司生产经营相关原材料现货市场价格波动带来的不确定性影响，公司将结合销售和采购计划安排，在保证正常生产经营的前提下，开展套期保值业务。

### （二）交易金额

结合公司生产经营业务实际情况，在不影响正常经营资金需求和资金安全的前提下，公司提供套期保值业务任一时点保证金最高占用额不超过人民币 6 亿元（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等），任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 14 亿元。期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过已审议额度。上述额度在有效期内可滚动循环使用。

### （三）资金来源

公司开展套期保值业务的资金来源为公司自有资金，不涉及募集资金。

### （四）交易方式

1. 交易品种：公司套期保值标的仅限于与公司现有生产经营相关的品种，包括工业硅、甲醇、煤炭等。

2. 交易类型：对工厂产能、工厂库存和贸易库存进行卖出套期保值；对工厂订单和贸易订单进行买入套期保值。

3. 交易工具及交易场所：以境内期货交易所的场内期货和期权交易为主，以跟金融机构的场外衍生品交易为辅，开展场外衍生品交易主要基于套期保值时间期限和结构的个性化需求，以及对场内流动性的补充需求。

### （五）交易期限

有效期自公司股东大会审议通过之日起 12 个月内。

## 二、审议程序

2024 年 8 月 8 日，公司召开第十一届董事会第十三次会议，审议通过了《关于开展套期保值业务的议案》。该事项尚需提交公司股东大会审议。

## 三、交易的内部控制措施

公司根据相关法律法规，编制了套期保值业务的可行性分析报告，制定了《套

期保值管理制度》和《套期保值管理制度细则》等内控制度，对套期保值业务的目的、品种、适用范围、组织架构和分工职责、业务流程、授权管理、报告制度、风险管理预案等方面做出了明确的规定，以期达到控规模、控敞口、控盈亏、控风险的管理效果。

#### 四、交易风险

公司始终遵循稳健原则开展套期保值业务，减少成品和原材料市场价格波动对公司带来的不确定性影响，但该事项仍存在一定的风险，包括但不限于以下风险：

1. 基差风险：基差是指现货价格和期货价格之间的价差，受多种因素影响，公司交易存在基差波动风险。
2. 操作风险：是指在套期保值业务执行过程中产生的错单操作风险。
3. 流动性风险：流动性风险主要包含两个方面，一是遇到期货和衍生品头寸反向波动带来的浮亏造成公司账户资金不足，导致被强制平仓的风险；二是期货和衍生品合约流动性不足所带来的风险。
4. 交易规则风险：对于交易所交易和交割规则不熟悉所带来的风险。
5. 技术基础设施风险：对于可能遇到的断网断电、电脑故障导致无法及时下单交易的风险。

#### 五、交易对公司的影响及相关会计处理

公司开展套期保值业务，旨在减少成品和原材料市场价格波动对公司带来的不确定性影响。

公司将根据套期保值业务的实际情况，根据财政部《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核算处理，在财务报表相关项目中正确反映。

特此公告。

浙江新安化工集团股份有限公司董事会

2024 年 8 月 9 日