

滨化集团股份有限公司 关于开展 2025 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。

重要内容提示：

- **交易目的、交易品种、交易工具、交易场所和交易金额：**为对冲产品、原材料价格及汇率波动风险，滨化集团股份有限公司（以下简称“公司”）拟通过境内外金融机构开展烧碱、聚丙烯、液化石油气、甲醇等大宗商品及汇率的期货套期保值业务，拟投入保证金不超过人民币0.8亿元，任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币4亿元。保证金额度可循环滚动使用，期限为自公司董事会审议通过之日起十二个月内，资金来源为公司自有资金。
- **已履行的审议程序：**该事项已经公司第六届董事会第三次会议审议通过，无需提交股东大会审议。
- **特别风险提示：**公司开展期货套期保值业务，不以套利、投机为目的，但进行期货套期保值交易仍可能存在市场风险、资金风险、技术风险、操作风险、违约风险等，公司将积极落实风险控制措施，审慎操作，防范相关风险。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

公司主营业务为有机、无机化工产品的生产、加工与销售，主要产品为烧碱、环氧丙烷等，原材料包括丙烯、液化石油气、甲醇等。为对冲产品、原材料价格及汇率波动风险，充分利用期货市场的套期保值功能，公司拟根据主营业务生产经营计划，

综合考虑采购、销售规模及套期保值业务预期成效等因素，开展与生产经营相关的原材料、产品、汇率的套期保值业务，促进主营业务稳健发展。

（二）交易金额

公司拟开展期货套期保值业务投入保证金不超过人民币0.8亿元，任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币4亿元。保证金额度在授权期限内可循环滚动使用。

（三）资金来源

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：烧碱、聚丙烯、液化石油气等与公司日常经营相关的大宗商品及汇率。

2、交易工具：期货、期权等金融工具。

3、交易场所：境内外经监管机构批准、具有相关业务经营资格的金融机构。

（五）交易期限

自公司董事会审议通过之日起十二个月内有效。如单笔交易的存续期超过授权期限，则授权期限自动顺延至该笔交易终止时止。

二、审议程序

公司于2025年1月15日召开第六届董事会第三次会议，审议通过了《关于开展2025年度期货套期保值业务的议案》，同意公司根据实际经营需求，开展期货套期保值业务。本次开展期货套期保值业务在董事会审批权限内，该议案无需提交股东大会审议。

三、交易风险及风控措施

（一）风险分析

公司通过期货套期保值操作可以规避产品、原材料价格及汇率波动对公司造成的影响，有利于公司的正常经营，但同时也可能存在一定风险，具体如下：

1、市场风险：期货及其他衍生产品行情变动幅度较大或流动性较差而成交不活跃，可能产生价格波动风险，造成套期保值损失；

2、资金风险：部分交易场所施行交易保证金逐日结算制度，可能会带来一定的资

金流动性风险。当市场价格出现巨幅变化时，可能因保证金不足、追加不及时被强行平仓的风险；

3、技术风险：由于无法控制或不可预测的系统、网络、通讯故障等造成交易系统非正常运行，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；

4、操作风险：由于交易员主观臆断或不完善的操作造成错单，给公司带来损失；

5、违约风险：由于交易对手出现违约，不能按照约定支付公司套期保值盈利而无法对冲公司实际的损失。

（二）风险控制措施

1、公司已制定《期货及衍生品套期保值业务管理制度》，对套期保值业务的审批权限、组织机构设置及职责、授权管理、执行流程和风险处理程序等作出明确规定，在整个套期保值操作过程中所有业务都将严格按照上述制度执行；

2、公司已建立完善的组织机构，设有套期保值领导小组、管理小组、执行小组和监督小组，配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员，明确相应人员的职责，并建立了符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统；

3、公司将合理调度资金用于套期保值业务，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，制定并执行严格的止损机制；

4、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，增强风险管理及防范意识；

5、公司将选择与资信好、业务实力强的经纪公司合作，以避免发生信用风险。

四、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是以日常经营需要为前提，不以套利和投机为目的，可借助期货市场的风险对冲功能，利用套期保值工具规避产品、原材料价格及汇率波动风险，有利于提升经营业绩的稳定性。

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》等相关规定，对拟开展的套期保值业务进行相应的会计处理。

特此公告。

滨化集团股份有限公司董事会

2025年1月15日