

浙江瀚叶股份有限公司
关于开展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个别及连带责任。

浙江瀚叶股份有限公司（以下简称“公司”）于2021年10月28日召开第八届董事会第二十次会议，会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，为降低大宗商品价格波动对公司经营业绩的影响，同意公司及控股子公司根据公司生产经营的实际情况以自有资金开展期货套期保值业务，预计开展期货套期保值业务投入保证金不超过人民币5,000万元，并授权董事长或其授权代表在计划额度内进行单项审批，授权期限自董事会审议通过之日起12个月内，前述额度在授权期限内可循环滚动使用。该议案无需提交公司股东大会审议。

一、开展商品期货套期保值业务的目的

公司及控股子公司生产经营所需主要原材料包括煤炭等，为充分利用期货市场的套期保值功能，减少因原材料价格波动造成的产品成本波动，促进产品成本的相对稳定，提升企业经营水平，保障企业持续健康运行，公司及控股子公司拟开展煤炭等期货品种套期保值业务，保证公司经营的相对稳定。

二、期货套期保值的开展方式

1、期货品种：公司拟开展的商品期货套期保值业务的品种限于公司及控股子公司生产经营相关的原材料品种，以煤炭为主；

2、投入资金规模及来源：预计开展期货套期保值业务投入保证金不超过人民币5,000万元，上述额度在授权期限内可循环滚动使用。资金来源为公司自有资金；

3、实施主体：公司及控股子公司；

4、期限及授权：

鉴于上述期货套期保值业务与公司的经营密切相关，公司董事会授权董事长或其授权代表在计划额度内进行单项审批，授权期限自董事会审议通过之日起12个月内，

在授权有效期内额度可循环滚动使用。如单笔交易的存续期限超过了授权期限，则该单笔交易的授权期限自动顺延至该笔交易终止时止。

5、会计处理相关说明：公司开展期货套期保值业务，将严格按照中华人民共和国财政部发布的《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》等相关规定进行会计处理。

三、期货套期保值业务的风险分析

公司及控股子公司开展期货套期保值业务主要为规避原材料价格的大幅波动对公司经营业绩带来的影响，但同时也会存在一定的风险：

1、价格波动风险：在期货行情变动较大时，公司可能无法实现在锁定价格以下买入/以上卖出套保合约；

2、操作风险：套期保值专业性较强，复杂程度较高，如操作人员未按规定程序进行商品期货套期保值操作或未充分理解商品期货信息，将带来操作风险；

3、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如套期保值投入过大，可能造成资金流动性风险，或未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失；

4、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，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题；

5、履约风险：开展套期保值业务存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险；

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，导致期货市场发生剧烈变动或无法交易的风险。

四、期货套期保值业务的风险控制措施

1、公司已建立《浙江瀚叶股份有限公司期货套期保值业务管理制度》，对套期保值交易的授权范围、审批程序、风险管理等做出了明确规定，能够有效规范期货套期保值交易行为，控制交易风险；

2、明确套期保值业务交易原则：套期保值业务将与公司生产经营相匹配，以保值为原则并结合市场情况，适时调整操作策略，最大程度对冲价格波动风险，提高保值效果；

3、公司将严格控制套期保值的资金规模，在授权额度范围内合理计划和使用保证金；

4、公司与具有合法资质的期货经纪公司或具有合法资质的金融机构开展套期保值

交易业务，规避可能产生的法律风险；

5、设置多层次审批决策机制，内控审计部不定期对套期保值业务进行检查，确保套期保值业务人员及其他相关部门人员在执行工作程序时严格遵循公司制度的要求。

五、独立董事意见

独立董事认为：公司开展期货套期保值业务，充分发挥期货市场的套期保值功能，有助于降低主要原材料市场价格波动对公司生产经营成本的影响，不存在损害公司和全体股东利益的情形。公司已制定了《浙江瀚叶股份有限公司期货套期保值业务管理制度》，对期货套期保值业务的审批权限、业务流程、风险管理等作出了明确规定，有利于控制和防范期货套期保值业务的相关风险。公司使用自有资金开展套期保值业务的相关审批程序符合有关法律、法规、规范性文件及《浙江瀚叶股份有限公司章程》的规定，我们同意公司开展期货套期保值业务。

公司指定信息披露媒体为《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》以及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn），有关信息均以在上述指定媒体刊登的相关公告为准。敬请广大投资者理性投资，注意投资风险。

特此公告。

浙江瀚叶股份有限公司董事会

2021年10月29日