

浙富控股集团股份有限公司

关于子公司 2023 年度开展商品期货套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

铜、锡、金、镍、钼等产品系公司危险废物无害化处理及再生资源回收利用业务板块的主要产品，为提高公司及子公司应对大宗商品价格波动风险的能力，更好地规避和防范公司所面临的大宗商品价格发生不利变动而引发的经营风险，增强公司财务稳健性，浙富控股集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 2 月 17 日召开了第五届董事会第二十六次会议，审议通过了《关于子公司 2023 年度开展商品期货套期保值业务的议案》，同意公司以自有资金在未来 12 个月任意时点余额不超过 200,000 万元人民币保证金的额度内，开展商品期货套期保值业务，保证金额度在上述额度范围内可滚动实施。

本次开展商品期货套期保值业务交易事项不构成关联交易，已经公司董事会全票审议通过，尚需提交公司股东大会审议。具体情况如下：

一、开展商品期货套期保值业务的目的

铜、锡、金、镍、钼等产品系公司危险废物无害化处理及再生资源回收利用业务板块的主要产品，公司各类金属产能规模不断扩大，原材料采购及库存商品已定价总量也不断增加，由于近期大宗商品价格波动加大，导致公司经营不确定因素增加。为防范公司所面临的大宗商品价格发生不利变动而引发的经营风险，公司有必要根据具体情况，适度开展商品期货套期保值业务。公司拟开展的商品期货套期保值业务与公司日常经营业务紧密相关，基于公司原材料采购、库存商品及大宗金属产品销售业务情况，能进一步提高公司应对大宗商品价格波动风险的能力，增强公司财务稳健性。

二、商品期货套期保值业务概述

1、商品期货套期保值业务交易品种

公司的套期保值业务，只限于从事与公司日常生产经营所需原材料、库存商品及销

售产品相同、相似或类似的期货品种，包括但不限于铜期货合约、锡期货合约、金期货合约、镍期货合约、钼期货合约及期权等等。

2、投入资金及业务期间

公司以自有资金在未来 12 个月任意时点余额不超过 200,000 万元人民币保证金的额度内，开展商品期货套期保值业务，保证金额度在上述额度范围内可滚动实施。

三、公司商品期货套期保值业务的管理情况

1、公司已制定《证券投资和衍生品交易管理制度》，对公司进行衍生品投资的风险控制、审议程序、后续管理等进行明确规定，以有效规范衍生品投资行为，控制衍生品投资风险。

2、公司财务管理中心具体负责公司衍生品投资事务。财务管理中心配备投资决策、业务操作等专业人员拟定衍生品投资计划并在董事会或股东大会授权范围内予以执行。

3、公司财务管理中心人员已充分理解衍生品投资的特点和潜在风险，严格执行衍生品投资的业务操作和《证券投资和衍生品交易管理制度》。

四、开展商品期货套期保值业务的风险分析

公司开展期货衍生品交易遵循套期保值的交易原则，不做投机性、套利性的交易操作，但衍生品交易操作仍存在一定的风险：

1、市场风险：因期货行情变动较大，可能产生因市场价格波动而造成亏损的市场风险。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。

3、技术风险：行情系统、下单系统等可能出现技术故障，导致无法获得行情或无法下单。

4、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。

5、信用风险：交易价格出现对交易对方不利的大幅度波动时，交易对方可能违反合约的相关规定，取消合约，造成公司损失。

6、政策风险：期货市场法律法规等政策如发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来风险。

五、开展商品期货套期保值业务的风险管理措施

1、将套期保值业务与公司生产经营相匹配，公司期货套期保值业务只允许与取得相应资质的机构、交易所交易，且仅限于操作与公司日常生产经营所需的原材料、库存商品及销售产品相同、相近或类似的商品期货品种，以此最大程度对冲价格波动风险。

2、严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，严格按照公司管理制度中规定的权限下达操作指令，根据规定进行审批后，方可进行操作。

3、公司制定并完善了《证券投资 and 衍生品交易管理制度》，对套期保值额度、品种、审批权限、组织机构、责任部门及责任人、授权制度、业务流程、风险管理制度、报告制度、档案管理等作出明确规定。

六、开展商品期货套期保值业务的可行性和对公司的影响

1、公司开展以套期保值为目的的期货衍生品交易，是为了满足经营管理需求，可以锁定未来时点的交易成本或收益，能够规避相关风险。

2、公司已制订《证券投资 and 衍生品交易管理制度》，对期货衍生品交易业务的操作原则、审批权限、操作程序及后续管理作出了明确规定，能够有效规范金融衍生品交易行为，控制交易风险。

3、公司及子公司在决议有效期内和拟定额度内开展期货衍生品交易业务，不会影响公司的正常生产经营。

七、独立董事意见

公司因经营管理需求，规避大宗商品价格波动风险，拟开展期货衍生品交易，以增强公司财务稳健性，符合公司的经营发展需要。公司已制定《证券投资 and 衍生品交易管理制度》及相关的风险控制措施，有利于加强期货衍生品交易风险管理和控制。相关业务履行了相应的决策程序，不存在损害公司及全体股东、特别是中小股东利益的情形。独立董事一致同意将该事项提交公司 2023 年第一次临时股东大会审议。

八、备查文件

- 1、浙富控股集团股份有限公司第五届董事会第二十六次会议决议；
- 2、独立董事关于第五届董事会第二十六次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

浙富控股集团股份有限公司董事会
二〇二三年二月十八日