

浙商中拓集团股份有限公司 关于 2025 年拟继续开展外汇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。

重要内容提示：

1、交易目的：浙商中拓集团股份有限公司（以下简称“公司”）为降低外汇市场风险，防范汇率、利率大幅波动对公司生产经营、成本控制造成不良影响，减少汇兑损失，降低财务费用，2025 年拟继续开展外汇套期保值业务。

2、交易品种：公司外汇套期保值业务的主要交易对手方为境内外金融机构，采用的均为市场标准的金融机构合约。公司及相关控股子公司的外汇套期保值业务只限于从事与公司生产经营所使用的主要结算货币币种及人民币汇率变动相关的币种，主要外币币种有美元、欧元、英镑、日元、澳元、加元、新币、韩币、港币、印尼盾等。

3、交易工具：公司外汇套期保值业务包括远期结售汇，外汇、利率掉期，外汇、利率期货，外汇、利率期权，国债期货及相关组合产品等业务。

4、交易场所：公司开展外汇风险对冲交易仅允许通过银行、有资质期货经纪公司或证券公司参与交易，市场公开、透明，成交活跃。

5、交易金额：年度外汇套保规模不超过公司及各控股子公

司国际收支总规模的两倍；对公司外币负债、资产利率敞口进行套保的规模不超过公司外币负债、资产规模；公司及各控股子公司开展外汇套期保值业务，任一时点最高外汇持仓总金额不超过等值 65 亿美元（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）。

6、已履行及拟履行的审议程序：本次公司 2025 年拟继续开展外汇套期保值业务事项已经公司第八届董事会审计委员会 2024 年第六次会议、第八届董事会 2024 年第八次临时会议审议通过，尚需提交公司股东大会审议。

7、风险提示：公司及相关控股子公司开展外汇套期保值业务是为降低外汇市场风险，防范汇率大幅波动对公司生产经营造成不良影响，但也可能存在汇率波动风险、内部控制风险等，公司将积极落实内部控制制度和风险防范措施。敬请投资者充分关注投资风险。

一、投资情况概述

1、投资目的

随着公司国际业务的不断增加，外币结算日益频繁。为降低外汇市场风险，防范汇率、利率大幅波动对公司生产经营、成本控制造成不良影响，减少汇兑损失，降低财务费用，公司及相关控股子公司拟于 2025 年根据公司《外汇风险管理实施办法》继续开展外汇套期保值业务。公司开展外汇套期保值业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不以获取投资收益为目的，不做投机性、套利性的交易操作，资金使用安排合理，不影响公司主营业务的发展，有利于满足公司日常经营需求。

公司及相关控股子公司的外汇套期保值业务只限于从事与公司生产经营所使用的主要结算货币币种及人民币汇率变动相

关的币种，主要外币币种有美元、欧元、英镑、日元、澳元、加元、新币、韩币、港币、印尼盾等。

2、交易金额

年度外汇套保规模不超过公司及各控股子公司国际收支总规模的两倍；对公司外币负债、资产利率敞口进行套保的规模不超过公司外币负债、资产规模；公司及各控股子公司开展外汇套期保值业务，任一时点最高外汇持仓总金额不超过等值 65 亿美元（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）。

3、交易方式

公司外汇套期保值业务的主要交易对手方为境内外金融机构，采用的均为市场标准的金融机构合约。

公司进行的外汇套期保值业务包括远期结售汇，外汇、利率掉期，外汇、利率期货，外汇、利率期权，国债期货及相关组合产品等业务。

（1）外汇远期：与金融机构按约定的外汇币种、数额、汇率和交割时间，在约定的时间按照合同规定条件完成交割的外汇交易。

（2）外汇掉期：与金融机构约定以一种货币交换一定数量的另一种货币，并以约定价格在未来的约定日期进行反向的同等数量的货币买卖。

（3）外汇期权：向金融机构支付一定期权费后，获得在未来约定日期按照约定价格买卖一定数量外汇的选择权的外汇交易。

（4）结构性远期：对外汇远期、外汇期权等一般性远期产品在结构上进行组合，形成带有一定执行条件的外汇产品，以满足特定的保值需求。

(5) 利率掉期：与金融机构约定将目前外币借款浮动利率锁定为固定利率，并在约定时间内以约定利率完成利息交割。

(6) 货币互换：与金融机构约定将公司目前外币借款本金及浮动利率锁定为其他外币借款本金及固定利率，并在约定时间根据锁定的汇率及利率进行交割。

4、交易期限

购买的单个投资产品期限不得超过 12 个月。

5、资金来源

公司及相关控股子公司开展外汇套期保值业务，将根据与金融机构签订的协议缴纳一定比例的保证金，该保证金将使用公司及相关控股子公司的自有资金或占用金融机构对公司及相关控股子公司的授信额度。缴纳的保证金比例或占用的金融机构授信额度比例根据与不同外汇交易经纪机构签订的具体协议确定，预估范围在 0%-10%，外汇、利率套保持仓保证金金额任一时点不超过 5 亿元人民币。

二、审议程序

本次公司 2025 年拟继续开展外汇套期保值业务事项已经公司第八届董事会审计委员会 2024 年第六次会议、第八届董事会 2024 年第八次临时会议审议通过，尚需提交公司股东大会审议。

三、交易风险分析及风控措施

(一) 交易风险分析：

外汇套期保值交易可以有效降低汇率波动对公司经营的影响，但也可能存在如下风险：

1、汇率波动风险：在汇率行情变动较大的情况下，银行远期结售汇汇率报价可能偏离公司实际收付时的汇率，造成汇兑损失。

2、内部控制风险：外汇套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控制度、流程不完善而造成风险。

（二）风控措施：

1、公司及相关控股子公司开展外汇套期保值业务将严格执行以锁定汇率风险为目的进行套期保值的原则，不进行投机交易。

2、公司制定了《外汇风险管理实施办法》，对公司开展外汇套期保值业务审批程序、交易程序、风险控制、内部报告等进行了规范。

3、为避免汇率大幅波动风险，公司已配备专业团队进行专项外汇管理，加强对汇率的研究分析，实时关注国际市场环境变化，对不同品种的交易策略进行分类授权，适时调整经营策略，最大限度地避免汇兑损失。

4、公司审计部门将定期对外汇套期保值业务的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况进行审查。

四、交易相关会计处理

公司根据《企业会计准则第 22 号 - 金融工具确认和计量》及《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外汇套期保值业务进行核算处理。

五、备查文件

- 1、第八届董事会 2024 年第八次临时会议决议；
- 2、第八届董事会审计委员会 2024 年第六次会议决议；
- 3、公司出具的《关于开展外汇套期保值业务可行性分析报告》；
- 4、公司《外汇风险管理实施办法》。

特此公告。

浙商中拓集团股份有限公司董事会

2024年12月11日