

# 浙江万安科技股份有限公司

## 关于开展外汇套期保值业务的可行性分析报告

### 一、公司开展外汇套期保值业务的背景

随着浙江万安科技股份有限公司（以下简称“公司”）全球化业务布局的进一步深入和海外业务的拓展，公司外汇收支规模亦同步增长。鉴于国际经济、金融环境波动等因素影响，全球货币汇率、利率波动的不确定性增强。公司（含子公司）本次开展外汇套期保值业务，是为了有效防范和控制汇率波动对公司经营业绩的影响，控制外汇风险。公司将严格按照相关规定及流程，进行套期保值业务操作及管理。

### 二、公司开展外汇套期保值业务概述

为提高公司应对外汇波动风险的能力，增强公司财务稳健性，更好地维护公司及全体股东的利益，公司及控股子公司拟开展不超过 5 亿元人民币（或等值外币）外汇套期保值业务，交易品种包括但不限于远期结售汇、人民币外汇掉期、外汇掉期、远期外汇买卖、人民币外汇期权等外汇衍生产品业务。授权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）将不超过上述额度，上述额度可以在自股东会审议通过之日起 12 个月内循环滚动使用。

### 三、公司开展外汇套期保值业务的必要性和可行性

公司开展外汇套期保值业务是围绕公司主营业务进行的，不是单纯以盈利为目的的外汇交易，而是以具体经营业务为依托，以套期保值为手段，以规避和防范汇率波动风险为目的，以保护正常经营利润为目标，具有充分的必要性；公司通过开展外汇套期保值业务，可以锁定未来时点的交易成本或收益，实现以规避风险为目的的资产保值。

结合公司过往的操作经验，公司开展外汇套期保值业务能有效地降低汇率波动风险，具有必要性和可行性。

### 四、外汇套期保值业务的风险分析

1、开展外汇套期保值业务可能存在以下风险：

（一）汇率波动风险：外汇汇率波动较大时，套期保值交易的金额、期限、币种与所对冲的真实风险敞口不匹配，可能导致部分风险未能覆盖或产生新的风险。

（二）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，可能会由于内控措施不完善而导致风险。

（三）履约风险：在合约期限内合作金融机构出现倒闭、市场失灵等重大不可控风险情形或其他情形，导致公司合约到期时不能以合约价格交割原有外汇合约，即合约到期无法履约而带来的风险。

（四）法律风险：因相关法律法规发生变化或交易对手违反相关法律法规，可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

## 2、风险控制措施

（一）明确外汇套期保值业务交易原则所有外汇套期保值业务均以正常跨境业务和外币投融资业务为基础，以规避和防范汇率利率风险为目的，不从事以投机为目的的外汇衍生品交易。

（二）产品选择结构简单、流动性强、风险可控的套期保值产品开展外汇套期保值业务。公司将严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，设置风险限额，制定并执行严格的止损机制。

（三）交易对手选择，公司（含子公司）外汇套期保值业务的交易对手应选择资信良好、与公司合作历史长、信用记录良好的金融机构。

（四）外汇风险动态应对密切关注国际外汇市场动态变化，加强对汇率的研究分析，在外汇市场发生重大变化时，及时调整外汇套期保值策略，最大限度地避免汇兑损失。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，强化风险管理及防范意识。

（五）建立健全风险预警及报告机制实时关注市场动态，及时监测、评估风险敞口，定期向管理层和董事会提供风险分析报告；在市场波动剧烈或风险增大情况下，增加报告频度，并及时制订应对预案。

（六）内部审计部门根据情况对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定期检查或审计。

## 五、结论

公司拟开展的外汇套期保值业务与日常经营需求紧密相关，是基于公司外币资产、负债状况以及预期外汇收支情况进行，按照真实的业务背景开展外汇衍生品业务，以应对外汇波动给公司带来的汇率、利率波动风险，增强公司财务稳健性，符合公司稳健经营的要求。综上，公司开展外汇套期保值业务具有必要性和可行性。

浙江万安科技股份有限公司董事会

2026年4月15日