



厚普清洁能源（集团）股份有限公司

关于公司 2024 年度外汇衍生品套期保值业务的专项报告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 2 号——创业板上市公司规范运作》《深圳证券交易所创业板上市公司自律监管指南第 1 号——业务办理：1.2 定期报告披露相关事宜》等有关规定的要求，厚普清洁能源（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）董事会对公司 2024 年度衍生品投资情况进行了核查，现将相关情况说明如下：

一、外汇衍生品套期保值业务审议批准情况

公司于 2024 年 10 月 23 日召开了第五届董事会第十六次会议、第五届监事会第十二次会议，会议审议通过了《关于开展外汇衍生品套期保值业务的议案》，同意公司及控股子公司使用自有资金与银行等金融机构开展不超过 2,000 万美元或其他等值币种的外汇衍生品套期保值业务，具体方式或产品主要包括远期结售汇、外汇掉期、外汇买卖、外汇期权、利率互换、利率掉期、利率期权等或上述产品的组合业务。投资期限为自公司董事会审议通过之日起 12 个月内有效，上述额度在审批期限内可循环滚动使用。如单笔交易的存续期超过了授权期限，则授权期限自动顺延至该笔交易终止时止。

二、2024 年外汇衍生品套期保值业务的具体情况

公司对报告期内衍生品投资损益情况进行了确认，报告期内未产生公允价值变动收益，未产生投资收益。公司报告期内衍生品交易金额在董事会审议的额度范围内。

单位：万元

衍生品投资类型	初始投资金额	期初金额	本期公允价值变动损益	计入权益的累计公允价值变动	报告期内购入金额	报告期内售出金额	期末金额	期末投资金额占公司报告期末净资产比例
远期合约	708.07	0	0	0	708.07	708.07	0	0.00%

三、内控制度执行情况

公司内审部门负责对外汇衍生品交易的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况进行审查。公司已制定了《外汇衍生品交易业务管理制度》，对外汇衍生品交易业务操作规定、审

批权限、管理及内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等做出了明确规定，未有违反法律法规及规范性文件规定之情形。

公司开展套期保值业务来规避汇率和利率风险是合理的。公司从事套期保值产品交易业务时，慎重选择与实力较好的大型银行等金融机构开展外汇套期保值业务，密切跟踪相关法律法规，规避可能产生的法律风险。

四、交易风险分析及风控措施

1、公司开展外汇衍生品套期保值业务遵循合法、审慎、安全、有效的原则，不进行以投机为目的的外汇交易，所有外汇衍生品套期保值业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范外汇汇率大幅变动而带来汇兑损益或外汇利率风险为目的，不得从事超出经营实际需要的复杂外汇衍生品交易，不得以套期保值为借口从事外汇衍生品投机。但外汇衍生品套期保值业务的交易操作仍存在以下风险：①汇率波动风险：在外汇汇率走势与公司判断汇率波动方向发生大幅偏离的情况下，公司锁定汇率后支出的成本可能超过不锁定时的成本支出，从而造成公司损失。②内部控制风险：外汇衍生品套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部制度不完善而带来的风险。③交易违约风险：外汇衍生品套期保值业务对手出现违约，不能按照约定支付公司衍生品盈利从而无法对冲公司实际的汇兑损失，将造成公司损失。

2、为最大程度规避和防范汇率波动带来的风险，公司授权相关部门和人员将密切关注和分析市场环境变化，适时调整操作策略。

3、公司仅与经国家外汇管理局和中国人民银行批准、具有相应业务经营资格的金融机构进行交易，外汇衍生品套期保值业务必须基于公司的外币收（付）款的谨慎预测，外汇衍生品套期保值业务的交割期间需与公司预测的外币收款存款时间或外币付款时间相匹配，或者与对应的外币银行借款的兑付期限相匹配。

4、公司内审部门负责对外汇衍生品交易的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况进行审查。

5、公司已制定了《外汇衍生品交易业务管理制度》，对外汇衍生品交易业务操作规定、审批权限、管理及内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等做出了明确规定。

五、保荐机构核查意见

经核查，保荐机构认为：关于公司使用自有资金购买理财产品事项已经公司第五届董事会第二十二次会议审议通过；上述事项审批程序符合《公司法》《公司章程》《深圳证券交易所创业板股票上市规则》《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 2 号——创业板上市公

司规范运作》等有关规定；保荐机构对厚普股份在批准额度内使用自有资金购买理财产品事项无异议。

特此公告。

厚普清洁能源（集团）股份有限公司 董事会

二零二五年四月二十三日