

上海万业企业股份有限公司 关于开展金融衍生品交易业务的进展公告

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法律责任。

一、开展金融衍生品交易业务情况概述

上海万业企业股份有限公司（以下简称“公司”）于2023年4月27日召开的第十一届董事会第五次会议及2023年6月28日召开的2022年年度股东大会审议通过了《关于确定公司2023年度金融衍生品交易业务额度的议案》，同意公司在保证正常经营不受影响的前提下使用自有资金在任意时点余额不超过人民币5.5亿元的额度范围内开展雪球类金融衍生品交易业务，挂钩标的资产包括证券、指数，也可包括上述基础资产的组合。详情请见公司《关于确定公司2023年度金融衍生品交易业务额度的公告》（公告编号：临2023-017）。

二、金融衍生品交易业务进展情况

公司购入的雪球类金融衍生品标的挂钩中证500指数，盈亏情形取决于挂钩标的中证500指数的市场表现。根据财务部门初步统计，公司所持有的雪球类产品2024年1-6月累计浮亏金额为-5,559.30万元，其中，2024年第二季度浮亏金额为-3,263.78万元。

三、风险提示及风险控制措施

1、公司开展金融衍生品交易业务严格遵循合法、合规、审慎和安全的原则，且在批准的额度内开展。公司自2020年起开展雪球类金

融衍生品交易业务以来，已实现的该类投资收益累计达1.66亿元。但是进行雪球类金融衍生品交易业务仍会存在一定的风险：

（1）市场风险：雪球类产品持有期间挂钩标的中证500指数波动较大时，产品估值将会随之波动，可能产生较大浮亏或浮盈。

（2）流动性风险：公司为避免损失可能会持有雪球类产品至存续期到期结束。

2、针对上述风险，公司采取的风险控制措施如下：

（1）公司制定了《金融衍生品交易业务管理制度》，对衍生品交易的操作原则、审批授权、日常管理、风控机制等作出规定，规范业务操作，强化风险控制。

（2）公司严格控制开展雪球类金融衍生品交易业务的资金规模，不超过已审议的额度范围，未使用配资等其他投资杠杆，以确保资金整体安全。公司将最大限度控制投资风险，审慎开展雪球类金融衍生品交易业务。

（3）公司持续关注雪球类产品挂钩标的中证500指数波动情况，及时合理调整确保资金流动性充足。受中证500指数波动影响，目前所列示亏损金额为浮动亏损金额，未赎回之前，所投资产品盈亏情况尚不确定。

（4）公司内部审计部门将加强对金融衍生品交易业务执行情况监督、核查，及时对存在的问题提出整改意见，控制好风险。

四、对公司的影响

公司开展金融衍生品交易业务所使用的资金为闲置自有资金，不会对公司日常运营资金需求和业务的正常开展造成影响。截至2024年3月31日，公司持有货币资金共计25.10亿元，资产负债率为14.64%，公司货币资金较为充沛，风险抵抗能力强，资产负债率低，整体财务

状况良好。

上述事项对公司财务数据的影响未经审计，具体影响请以年度报告中数据为准，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

上海万业企业股份有限公司董事会

2024年7月3日