

浙江富特科技股份有限公司

关于开展外汇衍生品交易业务的可行性分析报告

一、开展外汇衍生品交易业务的背景

随着浙江富特科技股份有限公司（以下简称“公司”）海外业务持续拓展，公司外汇收支规模不断增长。同时，受国际政治、经济形势等因素影响，汇率和利率波动幅度不断加大，外汇市场风险显著增加。为规避和防范汇率、利率波动风险，公司及子公司拟开展外汇衍生品交易进行套期保值，提升公司主动管理汇率、利率波动风险的能力，增强财务稳健性。

二、开展外汇衍生品交易业务的概况

1、交易金额：公司及子公司拟开展总额不超过1亿人民币（或等值外币）的外汇衍生品交易业务，该额度自董事会审议通过之日起12个月内可以循环使用，有效期内任一时点的交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过上述额度。

2、交易品种与对方：交易品种包括但不限于远期结售汇、外汇互换、外汇掉期、外汇期权、利率掉期、利率期权等产品或上述产品的组合。交易对手方为经有关政府部门批准且具有外汇衍生品业务经营资质的银行等金融机构。

3、交易期限与授权：使用期限自董事会审议通过之日起12个月内有效。公司董事会授权董事长或其授权人士在额度范围和期限内，行使决策权并签署相关文件，由财务部负责具体实施。

4、资金来源：公司及子公司的自有资金或自筹资金，不涉及使用募集资金。

三、开展外汇衍生品交易业务的必要性和可行性

随着公司海外业务持续拓展，公司外汇收支规模不断增长。受国际政治、经济不确定因素影响，外汇市场波动较为频繁，公司可能产生汇兑损失的风险。为防范外汇市场风险，公司有必要根据具体情况，适度开展外汇衍生品业务。

公司制定了从事外汇衍生品交易业务相关的内部控制制度，对外汇衍生品交易的操作原则、审批权限、管理与实施、信息披露等作了明确规定，在开展业务时将切实执行公司内部管理制度，严防风险，规范运作。

四、开展外汇衍生品交易业务的风险分析

1、市场风险：因外汇行情变动较大，可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动引起外汇金融衍生品价格变动，造成亏损的市场风险。

2、履约风险：交易对手信用等级、履约能力及其他原因导致的到期无法履约风险。

3、法律风险：在开展交易时，如交易合同条款不明确，将可能面临法律风险。

4、操作风险：在开展交易时，如操作人员未按规定程序进行外汇衍生品交易操作或未能充分理解衍生品信息，将带来操作风险。

五、开展外汇衍生品交易业务的风险控制措施

1、公司及子公司开展外汇衍生品交易业务将遵循防范汇率波动风险、套期保值原则，以日常经营活动为基础，不进行投机性、套利性的交易操作。

2、公司制定了《证券投资、期货及衍生品交易管理制度》，对外汇衍生品交易的操作原则、审批权限、管理与实施、信息披露等作了明确规定，在开展业务时将切实执行公司内部管理制度，严防风险，规范运作。

3、公司会选择拥有良好信用且与公司已建立长期业务往来的金融机构作为交易对手方，审慎审查与交易对手方签订的合约条款，以防范履约风险和法律风险。

4、公司财务部将持续跟踪外汇衍生品公开市场价格或公允价值变动，及时评估外汇衍生品交易的风险敞口变化情况，并定期向公司管理层报告，发现异常情况及时上报，提示风险并执行应急措施。

六、开展外汇衍生品交易业务的可行性分析结论

公司及子公司开展外汇衍生品交易业务是围绕公司实际外汇收支业务进行的，以具体经营活动为依托，以规避和防范外汇汇率波动风险为目的，增强公司财务稳健性，符合公司稳健经营的要求。公司已制定了《证券投资、期货及衍生品交易管理制度》，并通过加强内部控制，落实风险防范措施。因此，公司及子公司开展外汇衍生品交易具有必要性和可行性。

浙江富特科技股份有限公司

董事会

2026年4月27日