

浙江天成自控股份有限公司

金融衍生品交易可行性报告

一、开展金融衍生品交易业务的目的

为提高资金使用效率和收益，在保证资金安全和正常生产经营的前提下，公司拟使用部分闲置自有资金开展金融衍生品交易业务，规避和防范汇率、利率波动，取得一定投资收益，从而降低财务费用，同时提升公司整体业绩水平，保障公司股东的利益。

二、拟开展的金融衍生品交易业务品种

公司拟开展交易的金融衍生品交易业务包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、货币互换、利率互换、外汇期货、外汇期权等产品及上述产品的组合。

三、拟开展的金融衍生品交易业务计划

公司及下属子公司拟使用不超过 20,000 万元（或等值外币）的自有资金开展金融衍生品交易业务，在上述额度及期限内，资金可以循环滚动使用。授权有效期自公司 2025 年年度股东会审议通过之日起至 2026 年年度股东会召开之日止，在上述额度及决议有效期内，资金可循环滚动使用。

四、金融衍生品投资的风险分析

1、信用风险：尽管交易对手均为信用良好的金融机构，但仍可能存在合约到期交易对手无法履约造成违约而带来的风险。

2、市场波动风险：在汇率利率波动较大的情况下，公司操作的衍生金融产品可能会带来较大公允价值波动；若市场价格优于公司锁定价格，将造成损失。

3、流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

4、操作性风险：衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控体系不完善、操作人员未及时或未充分理解衍生品信息，或未按规定程序进行交易操作而造成一定风险。

5、法律风险：因所在国家相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

五、风险管理措施

1、制度建设：公司已建立了《衍生品交易管理制度》，对公司及下属子公司

从事金融衍生品交易的操作原则、交易审批权限、操作程序、风险管理及信息披露作出了明确规定，能够有效规范金融衍生品交易行为，控制交易风险。

2、交易对手方管理：公司将严格筛选从事外汇衍生品交易业务的交易对手，仅与经营稳定、资信良好的具有合法资质的金融机构开展外汇衍生品交易业务，不得与前述金融机构之外的其他组织和个人进行交易，并审慎审查与交易对手方签订的合约条款。

3、持续的风险监控措施：财务部持续跟踪金融衍生品公开市场价格以及公允价值变动，及时评估交易风险敞口变化情况，并定期向公司管理层汇报，若发现异常情况及时上报，提示风险并执行应急措施。

4、监督检查：独立董事有权对公司购买的衍生金融产品进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

5、定期披露：公司将严格按照上海证券交易所的相关规定要求，及时完成信息披露工作。

六、开展金融衍生品交易业务的可行性分析结论

公司开展金融衍生品交易业务，不会对公司未来主营业务、财务状况、经营成果和现金流量造成较大影响。公司投资金融衍生品交易业务所使用的资金为闲置自有资金，不影响公司的日常运营资金需求和主营业务的正常开展。公司已制定《衍生品交易管理制度》，完善了相关内控流程，公司采取的针对性风险控制措施是可行的。公司开展金融衍生品交易业务有利于规避和防范汇率、利率波动，提高资金使用效率，获得一定的投资收益，进一步提升公司整体业绩水平，为股东获取更多的投资回报。有利于公司的长远发展，符合公司全体股东的利益，不会对公司正常经营产生重大不利影响。

浙江天成自控股份有限公司董事会

2026年4月28日