

宁波色母粒股份有限公司

关于公司开展期货套期保值业务的公告

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

重要内容提示：

1、交易目的：为锁定原材料成本，降低远期订单的塑料原材料价格波动风险，减少塑料原材料价格波动对公司正常经营的影响，公司及子公司拟就公司生产经营所需的塑料原材料开展期货套期保值业务。

2、交易方式及交易品种：公司及子公司拟开展的期货套期保值业务的交易场所仅限于境内合法运营的期货交易所，交易工具为期货，交易品种将只限于公司生产经营所需的聚乙烯、聚丙烯等塑料原材料，严禁进行以逐利为目的的任何投机交易。

3、交易金额及交易期限：公司及子公司拟以自有资金进行套期保值业务的保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）不超过 500 万元，且任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 4,500 万元，使用期限自董事会审议通过之日起至十二个月内，如单笔交易的存续期超过了决议的有效期限，则决议的有效期限自动顺延至单笔交易到期时止，在上述额度及决议有效期内，可循环滚动使用。

4、已履行的审议程序：公司于 2026 年 4 月 28 日召开第三届董事会第三次会议及第三届董事会审计委员会第二次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，该事项无需提交股东会审议。

5、风险提示：公司及全资子公司开展期货交易以套期保值为目的，但仍存在价格波动风险、资金风险、内部控制风险、技术风险等，敬请投资者注意投资风险。

宁波色母粒股份有限公司于 2026 年 4 月 28 日召开第三届董事会第三次会议，审议通过《关于公司开展期货套期保值业务的议案》，为锁定原材料成本，降低远期订单的原材料价格波动风险，减少原材料价格波动对公司正常经营的影响，公司及子公司拟就公司生产经营所需的塑料原材料开展期货套期保值业务。公司及子公司拟以自有资金开展套期保值业务，保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）不超过 500 万元，且任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 4500 万元，使用期限自董事会审议通过之日起至十二个月内，如单笔交易的存续期超过了决议的有效期，则决议的有效期自动顺延至单笔交易到期时止，在上述额度及决议有效期内，可循环滚动使用。该事项无需提交股东会审议，现将具体情况公告如下：

一、开展期货套期保值业务的目的及背景

公司及全资子公司专业生产塑料色母粒产品，所需主要原材料为聚乙烯和聚丙烯等塑料原材料，塑料原材料价格波动对公司及全资子公司的生产成本影响较大。

公司及全资子公司通过塑料原材料套期保值业务锁定生产经营中使用的聚乙烯和聚丙烯等塑料原材料远期价格，规避了聚乙烯和聚丙烯等塑料原材料价格大幅波动情形，减少因原材料价格波动造成的产品成本波动，降低原材料价格波动对公司及子公司生产经营的影响。

综上所述，在 2026 年度拟开展聚乙烯和聚丙烯等塑料原材料期货套期保值业务是必要的也是可行的。

二、开展期货套期保值业务的基本情况

1、开展期货套期保值业务目的

公司及子公司开展套期保值业务，主要是为了锁定塑料原材料成本，降低远期订单的塑料原材料价格波动风险，减少塑料原材料价格波动对公司正常经营的影响。公司及子公司开展套期保值业务以正常生产经营为目的，而非以盈利为目的的进行的投机或套利交易，不会影响公司主营业务的发展，公司资金使用安排合

理。

2、交易方式及交易品种

公司及子公司拟开展的期货套期保值业务的交易场所仅限于境内合法运营的期货交易所，交易工具为期货，交易品种将只限于公司生产经营所需的聚乙烯、聚丙烯等塑料原材料，严禁进行以逐利为目的的任何投机交易。

3、交易金额及交易期限

根据实际情况，公司及子公司拟以自有资金进行套期保值业务的保证金和权利金上限（包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等）不超过 500 万元，且任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 4,500 万元，使用期限自董事会审议通过之日起至十二个月内，如单笔交易的存续期超过了决议的有效期限，则决议的有效期限自动顺延至单笔交易到期时止，在上述额度及决议有效期限内，可循环滚动使用。

4、资金来源

公司及子公司将使用自有资金进行套期保值业务，不涉及使用募集资金或银行信贷资金。

三、开展期货套期保值业务的可行性

（一）具备了开展套期保值业务的必要条件

1、公司董事会授权总经理（或经总经理授权的人员）依据公司相关管理制度具体实施期货套期保值业务方案，签署相关协议及文件。

2、公司已经颁布的《宁波色母粒股份有限公司期货和衍生品交易管理制度》，作为进行套期保值业务的内部控制和风险管理制度，其对套期保值业务额度、套期保值业务品种范围、审批权限、内部审核流程、责任部门及责任人、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序等做出明确规定，能够有效的保证期货业务的顺利进行，并对风险形成有效控制，全资子公司参照执行。

3、公司及全资子公司目前的自有资金规模能够支持 2026 年度从事期货套期保值业务规模。

4、公司统一指导并监控套期保值业务的开展工作。

（二）公司应对套期保值业务风险的具体措施

1、价格波动风险

期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成投资损失。公司拟将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。

2、资金风险

套期保值交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金风险。公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，不使用募集资金直接或间接进行套期保值，同时加强资金管理的内部控制，不得超过公司董事会批准的保证金额度。

3、流动性风险

可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。公司将重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

4、内部控制风险

套期保值交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成风险。公司将严格按照《宁波色母粒股份有限公司期货和衍生品交易管理制度》等规定安排和使用专业人员，建立严格的授权和岗位制度，加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。同时建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序。

5、会计风险

公司套期保值交易持仓的公允价值随市场价格波动可能给公司财务报表带来的影响，进而影响财务绩效。公司将遵照《企业会计准则》，合理进行会计处理工作。

6、技术风险

从交易到资金设置、风险控制，到与期货公司的链路内部系统的稳定与套期保值交易的匹配等，存在着因系统崩溃、程序错误、信息风险、通信失效等可能导致交易无法成交的风险。公司将选配多条通道，降低技术风险。

四、开展套期保值业务对公司经营的影响分析

（一）期货套期保值业务对生产经营的影响

在保证正常生产经营的前提下，公司及全资子公司以自有资金开展聚乙烯和

聚丙烯等塑料原材料期货套期保值业务，有利于规避市场风险，对冲原材料价格波动对公司生产经营的影响，稳定年度经营利润，进行风险控制，减少和降低聚乙烯和聚丙烯等塑料原材料价格波动对公司正常生产经营的影响。可以避免价格波动所带来的利润波动，实现公司自身长期稳健的发展。

（二）期货套期保值业务对财务的影响

公司及全资子公司套期保值业务的相关会计政策及核算原则将严格按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则》相关规定执行。开展套期保值所使用的聚乙烯和聚丙烯等塑料原材料的公允价值变动，将计入公司的当期损益，从而将增加或减少公司利润水平。

五、相关审核、批准程序及专项意见

（一）独立董事专门会议情况

公司于2026年4月23日召开第三届董事会独立董事第一次专门会议，独立董事认为：公司及全资子公司在保证正常生产经营的前提下，使用自有资金开展原材料期货套期保值业务，有效规避和防范原材料价格波动给公司带来的经营风险，充分利用期货市场的价格风险管理功能，降低价格波动对公司的影响。公司开展原材料套期保值业务的相关审批程序合规，内部控制程序健全，符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，不存在损害公司和全体股东利益的情况。公司及全资子公司本次开展期货套期保值业务是可行的，风险是可以控制的。全体独立董事一致同意公司及全资子公司开展期货套期保值业务。

（二）董事会审议情况

公司于2026年4月28日召开的第三届董事会第三次会议审议通过了《关于开展期货套期保值业务的议案》，全体董事一致同意公司及全资子公司开展原材料期货套期保值业务。

六、备查文件

- 1、宁波色母粒股份有限公司第三届董事会第三次会议决议；
- 2、宁波色母粒股份有限公司第三届董事会独立董事专门会议第一次会议决

议；

2、宁波色母粒股份有限公司关于开展期货套期保值业务的可行性分析报告。

特此公告。

宁波色母粒股份有限公司董事会

2026年4月29日