

双良节能系统股份有限公司

关于开展期货投资业务的公告

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个别及连带责任。

重要内容提示：

1、交易概况：为避免原材料价格波动带来的不确定性影响，公司拟开展期货投资业务，通过期货套期保值的避险机制减少因原材料价格波动造成的产品成本波动。公司基于经营计划，拟投入期货投资业务的保证金总额不超过人民币10,000万元，投资种类包括铜、铝、热轧卷板及螺纹钢等公司使用的主要原材料相关期货品种。

2、审议程序：公司已于2023年4月24日召开了八届二次董事会与八届五次监事会，分别审议通过了《关于开展期货投资业务的议案》，本事项不涉及关联交易，本事项尚须提交公司2022年度股东大会审议。

3、风险提示：公司开展期货投资业务遵循规避原材料价格波动风险、稳定采购成本的原则，不会进行投机交易并严格进行风险控制，但期货市场具有市场风险、政策风险、流动性风险、技术风险等，存在一定的投资风险。

敬请广大投资者审慎投资，注意投资风险。

双良节能系统股份有限公司（以下简称“公司”）于2023年4月24日召开八届二次董事会和八届五次监事会，分别审议通过了《关于开展期货投资业务的议案》，根据《上海证券交易所股票上市规则》、《上海证券交易所上市公司自律监管指引第5号——交易与关联交易》、《公司章程》和《双良节能系统股份有限公司证券投资、期货和衍生品交易管理制度》的相关规定，公司将使用自有资金开展期货投资业务，在额度范围内授权公司管理层具体办理、实施相关事项，具体情况如下：

一、开展期货套期投资的业务概况

1、投资目的

公司主营产品溴化锂冷热机组、高效换热器、空冷系统及多晶硅还原炉等生产制造中原材料占成本比重较大，铜、铝、不锈钢和碳钢等是公司机械设备板块生产所需的主要原材料。根据公司实际的生产经营情况，为避免原材料价格波动带来的不确定性影响，公司拟开展期货投资业务以适当减少因原材料价格波动而造成的产品成本波动，保证公司主要产品成本水平的相对稳定，进而维护公司正常的生产经营利润。

2、投资额度

公司基于经营计划拟投入期货投资业务的保证金总额不超过人民币 10,000 万元，上述金额在有效期限内可滚动使用。

3、套期保值期货品种

交易品种限于与公司生产经营所需主要原材料相关的期货品种，如铜、铝、热轧卷板及螺纹钢等。

4、资金来源

公司自有资金，不涉及募集资金。

5、交易期限

自公司 2022 年度股东大会审议通过之日起 12 个月内。在此期间，公司董事会提请股东大会授权董事长/总经理及其授权人士在上述保证金额度及交易期限内行使期货投资业务的审批权限并签署相关文件，具体由公司证券投资、期货和衍生品交易领导小组负责实施。

6、投资可行性

(1) 公司生产所需的原材料主要是铜、铝、不锈钢和碳钢等，相关商品期货价格走势与上游原材料价格高度关联。公司因主营业务需要长期关注铜、铝、不锈钢和碳钢等大宗商品的市場情况及价格走势，对其价格的走势具有相当的熟悉程度。

(2) 公司拟投入的保证金金额不超过人民币 10,000 万元，占公司 2022 年度经审计货币资金的比例为 2.14%，占公司 2022 年度归属母公司所有者权益的比例为 1.46%，该投入金额将不会影响公司的正常经营。

(3) 公司已建立了《双良节能系统股份有限公司证券投资、期货和衍生品交易管理制度》，并依照该制度开展期货投资业务。

二、审议程序

公司已于 2023 年 4 月 24 日召开了八届二次董事会与八届五次监事会，分别审议通过了《关于开展期货投资业务的议案》，本事项不涉及关联交易，本事项尚须提交公司 2022 年度股东大会审议。

三、交易风险分析

公司进行期货投资业务以对现货保值为目的，主要为有效规避原材料及产品价格波动对公司带来的不利影响，但同时也会存在一定的风险：

（一）市场风险：当市场发生系统性风险、期货现货价格出现背离、行情变动较大时，公司可能会发生损失；

（二）政策风险：期货市场的法律法规等相关政策发生重大变化，从而导致期货市场发生剧烈变动或无法交易的风险；

（三）流动性风险：如果相应期货合约成交量较低，公司持仓无法在目标价位成交会令实际交易结果出现较大偏差进而带来损失；如投入金额过大也可能造成公司资金流动性风险；

（四）技术风险：由于无法控制或不可预测的系统、网络、通讯故障等造成交易系统非正常运行，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应的风险和损失。

四、公司采取的风险控制措施

1、公司已制定了《双良节能系统股份有限公司证券投资、期货和衍生品交易管理制度》，明确了开展期货投资业务的组织机构及职责、业务授权、业务流程、风险管理等内容，通过严格的内部控制指导和规范执行，形成较为完整的风险控制体系。

2、公司本次期货投资业务只限于在境内期货交易所交易的铜、铝、热轧卷板、螺纹钢等期货品种。

3、公司将严格控制期货投资的资金规模，审慎计划和使用保证金，合理调度自有资金用于期货投资业务，绝不使用募集资金直接或间接进行期货投资。如

投入资金有需要超过原审批额度的，应将该事项重新提交董事会及股东大会审议批准。

4、公司将严格遵守商品期货交易所相关规定，积极配合上海证券交易所及期货公司相关部门的风险管理工作。同时，公司不定期对套期保值业务进行检查以控制风险。

5. 加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解与对相应原材料行业的学习，及时合理地调整投资思路与方案。同时持续加强对相关业务人员的专业培训，提高期货从业人员的综合素养。

6. 公司将配备符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展。当发生故障时及时采取相应的预案以减少损失。

五、会计政策及核算原则

公司根据财政部《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 24 号—套期保值》、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》相关规定及其指南，对拟开展的金融衍生品投资业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目。具体以年度审计结果为准。

六、独立董事意见

公司独立董事认为：

1、公司拟开展的期货投资业务与公司日常经营紧密相关，有助于避免原材料价格波动带来的潜在风险，提高公司资金的使用效率，以及获取投资收益。

2、公司已建立相应的证券投资、期货和衍生品交易管理制度，将严格按照相关制度的规定进行风险控制和管理，有效防范、发现和化解风险，确保进行期货交易的资金相对安全。

因此，公司进行期货交易符合公司和股东的利益，不存在损害公司和中小股东权益的情形，我们同意公司本次开展期货投资业务。

七、监事会意见

公司监事会认为：公司开展期货投资业务是为了充分运用金融衍生工具规避公司主要原材料的价格波动，减少经营利润的不确定性以控制经营风险，具有一

定的必要性。公司开展期货投资业务，符合公司利益，不存在损害公司及全体股东，尤其是中小股东利益的情形。监事会同意公司本次开展期货投资业务。

八、保荐机构核查意见

经核查，公司保荐机构中国国际金融股份有限公司认为：公司使用自有资金利用期货市场开展铜、铝、热轧卷板、螺纹钢等与公司生产经营相关产品的套期保值业务降低生产经营相关原材料的市场价格波动对公司生产经营成本的影响，控制经营风险。该事项已经公司董事会、监事会审议批准，独立董事发表了明确同意的独立意见，履行了必要的程序。该事项不存在损害公司和全体股东利益的情形。

综上，保荐机构对公司开展期货套期保值业务的事项无异议。

九、备查文件

- 1、公司八届二次董事会决议；
- 2、公司八届五次监事会决议；
- 3、公司独立董事关于八届二次董事会相关审议事项之独立董事意见；
- 4、双良节能系统股份有限公司证券投资、期货和衍生品交易管理制度；
- 5、中国国际金融股份有限公司关于公司开展期货投资业务的核查意见；
- 6、双良节能系统股份有限公司关于开展期货投资业务的可行性分析报告

特此公告。

双良节能系统股份有限公司
二〇二三年四月二十五日