

中国石化上海石油化工股份有限公司 关于公司 2024 年度开展金融衍生品业务的公告

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法律责任。

重要内容提示：

- 为锁定成本或利润，应对市场变化，对冲风险，公司拟于银行金融机构开展货币类金融衍生品保值计划，以委托代理模式开展商品类金融衍生品保值计划。其中，商品类金融衍生品的计划交易量为原油 200 万吨、其它商品类金融衍生品的计划交易总量为 320 万吨；货币类金融衍生品计划交易额预计为 1 亿美元，拟采用金融工具为远期结售汇。

- 2024 年度金融衍生品业务计划经公司第十一届董事会第六次会议审议通过。

中国石化上海石油化工股份有限公司（“公司”）于 2024 年 3 月 20 日召开第十一届董事会第六次会议，审议通过公司《2024 年度金融衍生品业务计划》，同意公司 2024 年商品类金融衍生品保值计划、货币类金融衍生品保值计划。具体情况如下：

一、交易情况概述

（一）交易目的

为管理市场波动导致的实货价格风险、外汇风险、利率风险等特定风险引起的风险敞口，应对市场变化，对冲风险，公司拟开展商品类及货币类金融衍生品保值计划。公司开展前述金融衍生品交易与采购进口原油、出口成品油等业务紧密相关，通过合理必要的金融衍生品交易，全部或部分抵消风险敞口，保障成本或利润的锁定及主营业务盈利能力。

（二）交易金额

2024 年度，公司拟开展商品类金融衍生品保值计划的交易量为原油 200 万吨、其它商品类金融衍生品的计划交易总量为 320 万吨；拟采用 DTD Swa

p、Dubai Swap、DTD/Dubai Swap、Gasoil/Dubai Swap、Kero/Dubai Swap、L SFO/Dubai Swap 等交易工具；拟开展货币类金融衍生保值计划的交易额度预计为 1 亿美元，拟采用金融工具为远期结售汇。

2024 年度任意时点的交易量/交易金额(含前述交易的收益进行再交易的相关金额)不超过已审议额度。

(三) 资金来源

公司用于开展金融衍生品交易业务的资金来源为自有资金，不存在使用募集资金开展金融衍生品交易业务的情况。

(四) 交易方式

公司拟于银行金融机构开展货币类金融衍生品保值计划，以委托代理模式开展商品类金融衍生品保值计划。其中，2024 年炼油商品类金融衍生品保值计划：原油：200 万吨（1460 万桶）、远期运费合约（FFA）100 万吨、航煤：97 万吨/766 万桶、柴油：51 万吨/378 万桶、石脑油：44 万吨/392 万桶、汽油：8 万吨/67 万桶、沥青：22 万吨/164 万桶、船用燃料油：18 万吨/114 万桶；2024 年化工商品类金融衍生品保值计划：石脑油：40 万吨、对二甲苯 40 万吨。2024 年货币类金融衍生品保值计划：拟采用金融工具为远期结售汇。

(五) 交易期限

本次金融衍生品保值计划的相关额度使用期限为自第十一届董事会第六次会议审议通过之日起 12 个月内。

二、董事会审议情况

公司于 2024 年 3 月 20 日召开第十一届董事会第六次会议，全体董事一致审议通过了公司《2024 年度金融衍生品业务计划》及其附件《关于开展金融衍生品交易业务的可行性分析报告》，同意公司 2024 年商品类金融衍生品保值计划、货币类金融衍生品保值计划。

三、风险分析

公司金融衍生品交易均为了锁定成本或利润，应对市场变化，对冲风险，均有实际经营业务需求与之对应，有助于公司规避风险影响，稳定经营业绩。从金融衍生品业务来看，也存在一定风险，主要风险如下：

1. 因标的资产价格出现与预期逆向的变动可能带来损失的市场风险。
2. 因交易或管理人员的人为错误或系统故障、控制失灵而造成的操作风

险。

四、风险控制措施

就公司开展金融衍生品交易的风险风控措施：

1.选择结构简单、流动性强、风险可控的交易产品，并只能在董事会授权额度范围内进行，严格控制交易规模。

2.制定规范的业务操作流程和授权管理体系，配备专职人员，明确岗位职责，严格在授权范围内从事货币类金融衍生品业务；同时加强相关人员的业务培训及职业道德，提高相关人员素质，并建立异常情况及时报告制度，最大限度的规避操作风险的发生。

五、对公司的影响

公司开展金融衍生品交易有助于降低风险敞口，均不会影响公司日常资金的正常周转及公司主营业务的正常开展。

六、公司开展金融衍生品交易的会计核算政策

公司根据《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-套期会计》《企业会计准则第 37 号-金融工具列报》《企业会计准则第 39 号-公允价值计量》等相关规定及其指南，对金融衍生品交易业务进行相应的会计核算和披露。

特此公告。

中国石化上海石油化工股份有限公司董事会

二零二四年三月二十日