

无锡方盛换热器股份有限公司

关于增加商品套期保值业务保证金额度的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、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法律责任。

一、本次增加商品套期保值业务保证金额度的原因

无锡方盛换热器股份有限公司（以下简称“公司”）于2026年1月15日召开第四届董事会第十五次会议审议通过并披露了《关于开展商品套期保值业务的公告》（公告编号：2026-011）。套期保值的交易保证金最高额度不超过1,000万元，且期货期权套期保值数量原则上应不超过套期保值的现货数量。

随着公司业务量的增加，商品期货套保数量也将有所增加，加之近期铝价格市场波动较大，导致商品期货套期保值业务保证金提高，为了有效防范铝价变动带来的市场风险，降低价格波动对公司正常经营的影响，公司将根据实际经营情况，增加商品套期保值业务保证金额度，由原来的交易保证金最高额度不超过1,000万元增加至不超过3,000万元，该额度在有效期限内可循环滚动使用。商品套期保值业务保证金增加后，将进一步提高公司应对期货市场价格波动风险的能力，增加公司财务稳健性。

二、增加商品套期保值业务保证金额度后的交易情况概述

1、交易品种：上海期货交易所上市的铝期货合约、期权合约。

2、投入资金：套期保值的交易保证金最高额度不超过3,000万元，且期货期权套期保值数量原则上应不超过套期保值的现货数量。该额度在有效期限内可循环滚动使用。

3、资金来源：自有资金。

4、业务期限：授权期限与前次保持一致，即自公司 2026 年 1 月 15 日召开的第四届董事会第十五次会议审议通过之日起十二个月内有效。如单笔交易的存续期超过了授权期限，则授权期限自动顺延至该笔交易终止时止。

三、套期保值业务的风险分析

1、价格波动风险：期货期权行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成期货期权交易的损失。

2、资金风险：期货期权交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会存在未及时补充保证金而被强行平仓的风险。

3、内部控制风险：期货期权交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成的风险。

4、技术风险：可能会由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题而造成技术风险。

5、操作风险：存在由于操作员主观臆断或不完善的操作造成错单，给公司带来损失的风险。

6、违约风险：期货期权价格出现不利的大幅波动时，客户可能违反合同的相关约定，取消产品订单，造成公司损失。

四、风险控制措施

1、公司将套期保值业务与其他经营业务相匹配，最大程度对冲价格波动风险。公司套期保值业务只限于在境内期货交易所的铝商品期货期权，严禁进行以逐利为目的的任何投机交易。

2、公司将按照相关资金管理制度，合理调度和严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。自本议案经董事会通过之日起 12 个月内，公司各项套期保值业务必须严格限定在经批准的套期保值计划内进行，不得超范围操作。

3、公司已制定《商品套期保值业务管理制度》，规定公司进行套期保值业务只能以规避经营所需产品价格变动风险为目的，不得进行投机和套利交易。

同时公司设立套期保值领导小组，作为管理公司套期保值业务的执行机构。

4、公司设立符合要求的交易、通讯及信息设施系统，确保交易系统的正常运行，确保交易工作的正常开展，当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。套期保值业务的风险影响事件，本公司将及时进行公告。

五、会计政策及核算原则

公司根据财政部颁发的《企业会计准则》规定的会计政策对套期保值业务进行会计核算。

六、相关审核及批准程序

2026年3月15日召开的第四届董事会战略委员会第五次会议审议通过《关于增加商品套期保值业务保证金额度的议案》，2026年3月18日召开的第四届董事会第十六次会议审议通过《关于增加商品套期保值业务保证金额度的议案》，本议案尚需提交股东会审议。

七、备查文件目录

- （一）《无锡方盛换热器股份有限公司第四届董事会第十六次会议决议》；
- （二）《无锡方盛换热器股份有限公司第四届董事会战略委员会第五次会议决议》。

无锡方盛换热器股份有限公司

董事会

2026年3月19日