

## 恒力石化股份有限公司 关于开展2024年度期货套期保值业务的公告

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：

- 交易目的：**为合理规避主要原材料及产品的价格大幅波动风险，充分利用期货市场功能，有效管理价格大幅波动的风险，提升企业经营水平，保障企业健康持续运行。
- 交易品种：**与生产经营相关的原油、石油制品、PTA、化工品（包括但不限于苯乙烯、乙二醇、聚丙烯）等商品品种。
- 交易工具及场所：**包括期货合约、掉期以及期权等工具。主要交易场所包括上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所等境内期货交易所及新加坡交易所（SGX）等境外期货交易所。
- 交易金额：**预计开展期货套期保值所需保证金不超过人民币 51.09 亿元。
- 履行的审议程序：**公司于 2024 年 4 月 9 日召开第九届董事会第十九次会议，审议通过了《关于开展 2024 年度期货套期保值业务的议案》。本议案尚需提交公司股东大会审议批准。
- 特别风险提示：**公司及下属公司开展套期保值业务不以投机为目的，主要为规避原油和产品价格的大幅波动对公司带来的影响，可能存在价格波动风险、资金风险、内部控制风险、技术风险、政策风险等，敬请投资者注意。

### 一、交易情况概述

#### （一）交易目的

恒力石化股份有限公司（以下简称“公司”）下属公司主要经营原油加工及石油制品生产与销售、PTA、化工品（包括但不限于苯乙烯、乙二醇、聚丙烯）等生产与销售，主营业务所涉及的主要原材料及产品价格受国际政治经济形势和大宗商品价

格的影响较大，为合理规避原油和产品价格的大幅波动给公司经营带来的不利影响，拟开展套期保值业务，充分利用期货市场功能，有效管理价格大幅波动的风险，提升企业经营水平，保障企业健康持续运行。

## （二）交易金额

根据生产经营计划，本着谨慎原则，2024 年预计开展期货套期保值所需保证金不超过人民币 51.09 亿元（其他币种按当期汇率折算成人民币汇总），采用滚动建仓的方式，额度在期限内可以循环使用。

## （三）资金来源

开展期货套期保值业务，需要使用一定比例的银行授信额度或自有资金作为保证金，不涉及募集资金，缴纳保证金不会对公司的资金使用计划造成不利影响。

## （四）交易方式

1、交易品种：公司及下属公司拟开展的套期保值业务品种限于与生产经营相关的原油、石油制品、PTA、化工品（包括但不限于苯乙烯、乙二醇、聚丙烯）等商品品种。

2、交易工具：包括期货合约、掉期以及期权等工具。

3、交易场所：主要包括上海期货交易所、郑州商品交易所、大连商品交易所等境内期货交易所及新加坡交易所（SGX）等境外期货交易所。

公司通过下属公司恒力石化国际有限公司（Hengli Petrochemical International Pte. Ltd.）在境外开展有关的期货套期保值业务。

## （五）交易期限

本次开展商品期货套期保值业务的期限为自公司股东大会审议通过之日起 12 个月内。

## 二、审议程序

公司于 2024 年 4 月 9 日召开第九届董事会第十九次会议，审议通过了《关于开展 2024 年度期货套期保值业务的议案》。本议案尚需提交公司股东大会审议批准。

## 三、风险分析及风控措施

### （一）风险分析

公司及下属公司开展期货交易业务不以投机为目的，主要为合理规避原油和产品价格的大幅波动对公司带来的影响，但可能存在一定风险，具体包括但不限于：

1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格变化方向与公司预测判断

相背离的情况，造成期货交易的损失。

2、**资金风险**：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能会带来相应的资金风险。此外，在期货价格波动巨大时，甚至可能存在未及时补充保证金而被强行平仓带来实际损失的风险。

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

4、**技术风险**：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，使交易指令出现延迟、中断或数据错误等问题，从而带来相应风险。

5、**政策风险**：由于国家法律、法规、政策变化以及期货交易所交易规则的修改和紧急措施的出台等原因，从而导致期货市场发生剧烈变动或无法交易的风险。

6、**境外交易风险**：境外交易市场存在汇率波动风险和 Related 国家政策变动导致无法交易而带来损失的风险。

## （二）风控措施

1、公司制定了期货套期保值业务的相关管理制度，明确了开展套期保值业务的组织机构、专业人员配备及职责、审批授权、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、公司持续跟踪衍生品公允价值变动和风险敞口变化情况，当市场发生重大变化或出现重大浮亏时按公司制定的应急机制及时应对，采取相关措施妥善处理。

3、将套期保值业务与下属公司生产、经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。

4、公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。

5、公司内控审计部定期或不定期对套期保值业务进行检查，监督套期保值工作的开展，防范业务中的操作风险。

6、设立符合要求的交易、通讯及信息服务设施系统，保证交易系统的正常运行，确保交易工作正常开展。当发生错单时，及时采取相应处理措施，并减少损失。

7、加强对国家及相关管理机构相关政策的把握和理解，及时合理地调整套期保值思路与方案。

## 四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司及下属公司开展期货套期保值业务有助于合理规避原油和产品价格的大幅

波动给公司经营带来的不利影响，有效管理价格大幅波动的风险，不会对公司日常资金正常周转及主营业务正常开展造成影响。

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》等相关规定及其指南，对期货套期保值业务进行相应核算和披露。

特此公告。

恒力石化股份有限公司董事会

2024 年 4 月 10 日