

股票代码：A600845 B900926 股票简称：宝信软件 宝信 B 编号：临 2024-013

上海宝信软件股份有限公司 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。

上海宝信软件股份有限公司（以下简称“宝信软件”或“公司”）于 2024 年 3 月 28 日召开第十届董事会第十八次会议，审议通过了《2024 年度开展金融衍生品业务的议案》，具体情况如下：

一、2023 年金融衍生品业务完成情况

公司开展金融衍生品业务遵循稳健原则，不进行以投机为目的的外汇交易，所有金融衍生品业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范汇率风险为目的。通过与长期合作供应商积极沟通，利用合同给定波动预期、利用人民币作为主要结算工具等方式，积极推进人民币结算业务。2023 年公司未新增衍生品业务，无新增衍生品业务交易，无持仓金额。

二、2024 年金融衍生品业务计划

为有效地规避和防范外汇汇率波动对公司经营造成的不利影响，公司拟于 2024 年审慎开展以套期保值为目的的金融衍生品业务，包括但不限于远期合约、期权、掉期及其组合产品。主要外币币种为日元、美元和欧元。

公司 2024 年风险敞口规模及套保额度，是根据公司 2024 新增业务、以前年度在执行中存量业务的实际外汇收支需求，结合业务的交割金额和

交易期限与预期外汇收付款时间相匹配等因素，按照业务规模、期限等不得超过资金需求合同范围的原则确定的。公司 2024 年经营性业务下预计形成的结售汇风险敞口净额（原币种）为：美元 974 万、欧元 566 万、日元 17.22 亿。

三、具体风险管控措施

公司建立有效的金融衍生业务风险管理体系，内控机制、严守套保原则，并持续强化风险预警，覆盖事前防范、事中监控和事后处理的各个环节。

1. 严守套期保值原则，禁止进行投机和套利交易。当市场发生重大变化时，及时评估金融衍生业务对外币风险敞口的对冲效果，客观评估金融衍生业务的套保效果。

2. 制定了《金融衍生业务管理办法》并同时制定专门的业务操作手册，明确相关部门职责、业务审批程序、风险管理要求、预警止损机制、应急处理等内容。公司严格按照《金融衍生业务管理办法》的规定进行操作，控制业务风险，保证金融衍生业务管理办法有效执行。

3. 进行外汇套期保值交易必须基于公司进口项下的外币付款预测或出口项下的外币收款预测。远期合约的外币金额不得超过外币收款或外币付款预测金额，外汇套期保值业务交割期间需与公司预测的外币付款时间或外币收款时间相匹配。

4. 建立了金融衍生业务垂直管理体系，各子公司首次开展的金融衍生业务在经过本公司董事会或类似决策机构同意后，向集团公司提交申请开展金融衍生业务的议案，经集团公司董事会核准同意后开展金融衍生品业

务。

四、审议程序

1、公司于2024年3月15日召开第十届审计委员会第十次会议，审议通过了《2024年度开展金融衍生品业务的议案》，同意提交董事会审议；

2、公司于2024年3月28日召开第十届董事会第十八次会议，审议通过了本议案；

3、本议案无需提交股东大会审议，由董事会审议批准。

特此公告。

上海宝信软件股份有限公司

董 事 会

2024年3月30日