

西南证券股份有限公司关于大连热电股份有限公司董事会 关于股票价格波动是否达到《上海证券交易所上市公司自律监管 指引第 6 号——重大资产重组》相关标准的核查意见

一、上市公司股票价波动情况

大连热电股份有限公司（以下简称“上市公司”）拟向大连洁淨能源集团有限公司或其指定的第三方出售公司全部资产及负债，并拟发行股份购买恒力石化股份有限公司、江苏恒力化纤股份有限公司持有的康辉新材料科技有限公司的全部股权并募集配套资金（以下简称“本次交易”）。

西南证券股份有限公司（以下简称“独立财务顾问”）作为上市公司本次交易的独立财务顾问，对《大连热电股份有限公司董事会关于股票价格波动是否达到《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 6 号——重大资产重组》相关标准的说明》进行核查。

上市公司因筹划本次交易，经向上海证券交易所申请，上市公司股票自2023年6月21日开市起停牌。上市公司股票在停牌前1个交易日、前20个交易日期间的股票价格、上证综合指数（代码：000001.SH）以及申万热力服务指数（代码：851614.SL）的累计涨跌幅情况如下：

项目	停牌前第21个交易日 (2023年5月23日)	停牌前第1个交易日 (2023年6月20日)	涨跌幅
股票收盘价(元/股)	5.26	4.85	-7.79%
上证指数	3,246.24	3,240.36	-0.18%
申万热力服务指数	1,958.08	1,911.49	-2.38%
剔除大盘因素影响涨跌幅(%)			-7.61%
剔除同行业板块行业因素影响涨跌幅(%)			-5.41%

资料来源：同花顺

上市公司股价在停牌前 20 个交易日日期内波动幅度为下跌 7.79%，扣除同期上证综合指数累计跌幅 0.18%的因素后，下跌幅度为 7.61%；扣除同期申万热力服务指数累计下跌 2.38%的因素后，下跌幅度为 5.41%。

综上，剔除大盘因素和同行业板块因素后，公司股价在本次股票停牌前 20

个交易日内累计涨跌幅未超过 20%。

二、独立财务顾问核查意见

西南证券股份有限公司作为本次交易的独立财务顾问，经核查认为：剔除大盘因素和同行业板块因素后，公司股价在本次股票停牌前 20 个交易日内累计涨跌幅未超过 20%。

（以下无正文）

（本页无正文，为《西南证券股份有限公司关于大连热电股份有限公司董事会关于股票价格波动是否达到<上海证券交易所上市公司自律监管指引第6号——重大资产重组>相关标准的核查意见》之签字盖章页）

独立财务顾问主办人：

孔辉焕

李文松

艾 玮

西南证券股份有限公司

2023年7月4日