

证券代码：600888

证券简称：新疆众和

编号：临 2021-016 号

## **新疆众和股份有限公司**

### **关于 2021 年度开展套期保值及远期外汇业务的公告**

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个别及连带责任。

新疆众和股份有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 3 月 9 日召开了第八届董事会第六次会议，审议通过了《公司关于 2021 年度开展套期保值及远期外汇业务的议案》，并将提交公司 2020 年年度股东大会审议，具体内容如下：

#### **一、铝、玻璃、PVC、螺纹钢和热轧卷套期保值业务**

##### **（一）从事套期保值的目的**

根据公司生产经营需要，合金产品、铝制品等铝加工产品所需的部分铝相关原材料需从外部采购，但由于铝价波动较大，对公司上述原材料采购价格产生不利影响；玻璃、PVC、螺纹钢和热轧卷是公司结构材料分公司门窗业务、冶金建设分公司电解槽大修、炉窑等业务所需主要原材料，随着分子公司业务开拓，对原材料的需求大幅增加；在公司产品销售过程中，高纯铝、合金产品、铝制品等产品以铝价为基础进行定价；大宗商品价格波动将对公司上述产品成本、销售价格以及利润产生较大影响。

通过开展套期保值业务，可以锁定原材料采购成本和产品销售价格，降低原材料采购价格、产品销售价格波动风险，从而达到锁定相应经营利润的目的，降低对公司正常生产经营的影响。

公司利用套期保值进行风险控制，不进行以逐利为目的的任何投机交易。

## （二）套期保值的品种及套期保值数量

公司套期保值业务仅限于公司生产经营涉及的大宗商品铝、玻璃、PVC、螺纹钢和热轧卷。2021年，公司预计买入铝、玻璃、PVC套期保值数量分别不超过5万吨、2万吨、0.3万吨，预计买入螺纹钢和热轧卷的套期保值合计数量不超过2万吨；公司预计卖出铝套期保值数量不超过16万吨。

公司任何时点套期保值持仓量不得超过实际订单生产所需采购或销售的现货量。

## （三）套期保值资金来源及持仓时间

公司在套期保值业务中投入的资金全部为自有资金；业务期间为自本议案经公司2020年年度股东大会审议通过之日起至公司2021年年度股东大会召开之日止。公司结合产品的生产成本、销售价格、利润目标及市场分析情况，在价格达到目标价位时开始保值。在套期保值合约开仓后，公司原则上配合现货采购/销售将所持头寸逐步平仓，买入套期保值头寸持有时间不超出公司原材料采购合同（订单）实际执行的时间，卖出套期保值头寸持有时间不超出公司销售合同（订单）实际执行的时间；如果确实出现足以影响价格长期走势的重大变化，公司可以根据已开仓合约的情况，进行平仓操作，以锁定利润或避免亏损扩大。

## （四）套期保值的风险分析

1、价格波动风险：大宗商品价格变动较大，可能产生价格波动风险，造成交易损失。

2、资金风险：期货交易等采取保证金和逐日盯市制度，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。

3、流动性风险：可能因成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

4、内部控制风险：套期保值专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于

内控体系不完善或人为操作失误所造成的风险。

5、技术风险：可能因为计算机系统不完备导致技术风险。

#### （五）公司拟采取的风险控制措施

1、公司将严格按照《公司期货套期保值内部控制制度》的规定进行套期保值交易。坚持只从事与现货经营相对应的套期保值业务，不从事任何形式的市场投机行为。

2、公司使用自有资金进行套期保值业务，不使用募集资金、银行贷款等不符合国家法律、法规和中国证监会、上海证券交易所规定的资金；同时加强资金管理的内部控制与合理调度。

3、公司将重点关注套期保值交易情况，合理选择套期保值合约月份，避免市场流动性风险。

4、公司已经设立期货套保管理小组负责对套期保值业务进行日常监督和管理，下设期货套保办公室负责具体套期保值业务的实施和操作；并按照《公司期货套期保值内部控制制度》实施公司套期保值业务日常报告制度及风险报告制度，形成高效的风险处理程序；风险控制人是套期保值业务风险管控第一责任人，要严格按照岗位职责的工作程序履行风险监控程序；公司审计部每月对套期保值业务进行合规性检查，并向公司期货套保管理小组提交合规报告。

5、公司已经设立了符合要求的交易、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。

## 二、远期外汇交易业务

随着公司国际业务的不断拓展，外汇收支额度不断加大，为降低国际业务的汇率与利率波动的不确定性，结合业务资金需求，公司拟开展美元、欧元、日元、英镑或其他币种的外汇远期结售汇业务、外汇买卖业务、外汇掉期业务、外汇期

权业务、利率互换业务等远期外汇交易业务

外汇远期结售汇业务，是通过外汇指定银行与客户协商签订远期结售汇协议，约定未来办理结汇或售汇的外币币种、金额、汇率和期限，到期时，即按照该协议的约定办理结售汇业务。

外汇掉期业务，是在委托日向银行买进即期外汇的同时又卖出同种货币的远期外汇，或者卖出即期外汇的同时又买进同种货币的远期外汇。

外汇期权业务是指合约购买方在向出售方支付一定期权费后，所获得的在未来约定日期或一定时间内按照规定汇率买进或者卖出一定数量外汇资产的选择权。

利率互换业务是指交易双方约定在未来一定期限内，根据约定的本金分别以合同利率和参考利率计算规则确定利息并进行利息交换的金融合约。

#### （一）开展远期外汇业务的目的

公司部分产品出口国外市场，近年来，随着公司国际化战略的不断推进，公司国际业务比重逐步增加，并且主要采用美元等外币进行报价和结算，人民币对美元等外币汇率波动对公司生产经营的影响逐渐加大。为减少汇率波动对公司生产经营及利润的影响，公司拟开展远期外汇交易业务。

公司开展远期外汇交易业务为实际业务服务，不进行以逐利为目的的任何投机交易

#### （二）从事远期外汇业务的币种及数量

根据公司实际业务的需要，针对与国外客户实际签订的合同规模，公司2021年将根据外汇收支情况，开展美元、欧元、日元、英镑或其他币种的外汇远期结售汇业务、外汇买卖业务、外汇掉期业务、外汇期权业务、利率互换业务等远期外汇交易业务。公司严格以实际业务需要为目标，开展远期外汇交易业务的交易金额不超过公司收付外币金额与外币融资总额。

### （三）开展远期外汇业务的有效期

本次远期外汇业务的有效期自2020年年度股东大会审议通过之日起至2021年年度股东大会召开之日止。

### （四）业务管理机构及操作流程

公司董事会授权远期外汇业务由公司经营层统一决策，具体实施操作由财务部门进行。具体流程是：业务单位上报外汇收付计划，包括币种、时间和金额等，上报公司财务部门；财务部门根据业务单位计划制订远期外汇业务方案，报公司审批；公司审批通过后，由财务部门负责远期外汇业务的具体操作，逐笔登记台账，定期向公司报告远期外汇业务的执行情况。

### （五）风险控制措施

公司制定了《外汇及衍生品管理办法》，从决策程序、风险评估、岗位设置、交易记录、审计监督等方面对远期外汇业务进行控制，防范风险，主要如下：

1、公司开展外汇业务及金融衍生品业务，必须以规避防范外汇汇率波动风险为前提，以减少汇兑损失实现外汇资产的安全为目的，最大程度减少外汇负债，最优的成本锁定原则，以公司实际需要为出发点，不得以投机为目的进行投机交易。

2、公司在开展远期外汇业务时，应当根据公司的风险承受能力，合理确定远期外汇业务的风险限额和相关交易参数，并就交易的目标、策略、执行、报告及风险控制等内容以书面形式提交有权部门审议，经审议通过后方可执行。

3、公司办理远期外汇交易实行逐级审批制度，即业务人员根据公司内控程序和操作细则规定的权限，按照部门负责人下达的交易指令在权限范围内进行操作，不得越权审批或未经授权操作。

4、财务部门应当结合对远期外汇交易风险的评估，制定交易控制措施，包括交易头寸建立后，面对不同情况的应对措施，以及设置止损点等；从事交易记

录的人员，应当及时从金融机构处取得业务交易的原始单据，并做好原始记录；对开设的远期外汇交易账户应当严格管理，每个交易日后由业务人员对持有的头寸进行分析，并对资金往来进行核对；明确远期外汇交易和风险限额，在操作过程中要严格执行操作方案中的止盈、止损制度。

5、公司内部审计部门及法律部门负责对公司远期外汇交易相关业务记录和风险控制制度的设计与执行情况进行审查。

6、公司远期外汇业务只允许与具有合法经营资格的金融机构以进行交易，不得与非正规的机构进行交易。

特此公告。

新疆众和股份有限公司董事会

2021年3月10日