

## 江苏丰山集团股份有限公司

### 关于 2021 年度开展金融衍生品交易业务的公告

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。

江苏丰山集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2021 年 3 月 30 日召开了第三届董事会第三次会议，审议通过了《关于公司 2021 年度开展金融衍生品交易业务的议案》，现将相关事宜公告如下：

#### 一、开展金融衍生品交易业务的目的

随着公司海外销售规模的不断扩大，产品出口结算货币主要是美元和欧元，因此当外汇汇率出现较大波动时，会产生汇兑损益，对公司经营业绩产生一定影响。为了有效规避外汇市场的风险，降低汇率波动对公司利润的影响，以及基于公司经营战略的需要，公司 2021 年拟选择适合的市场时机开展金融衍生品交易业务，利用外汇衍生交易的套期保值功能规避汇率风险。

#### 二、拟开展金融衍生品业务的基本情况

##### （一）业务品种

公司拟开展的金融衍生品工具包括但不限于远期结售汇、结构性远期、外汇掉期、货币期权等产品及上述产品的组合。

##### （二）业务规模及资金来源

此次开展的金融衍生品交易业务预计不超过 8,000 万美元（其他币种按当期汇率折算成美元汇总），资金来源为公司自有资金，不涉及募集资金。

##### （三）交易期限

有效期自公司董事会审议通过之日起 12 个月内有效。

##### （四）决策授权

为了提高工作效率，保证后续工作的顺利开展，董事会授权公司董事长或董事长授权经营管理层在余额不超过 8,000 万美元额度范围内行使金融衍生品交易业务的审批权限并签署相关文件，在额度范围内资金可滚动使用，由公司财务

部门负责具体实施相关事宜。

### **三、金融衍生品交易业务的风险分析**

#### **1、汇率波动风险**

在汇率波动较大的情况下，公司操作的衍生金融产品可能会带来较大公允价值波动；若市场价格优于公司锁定价格，将造成汇兑损失。

#### **2、汇款预测风险**

公司根据客户订单和预计订单进行回款预测，但在实际执行过程中，客户可能会调整自身订单和预测，造成公司回款预测不准确，会导致已操作的汇率衍生品延期交割风险。

#### **3、操作性风险**

在开展金融衍生品交易业务时，如操作人员未按规定程序审批及记录，将可能导致衍生金融产品损失或丧失交易机会；同时若交易员未充分理解业务信息及衍生金融产品条款，将带来法律风险及交易损失。

### **四、公司采取的风险控制措施**

1、为防止远期结售汇延期交割，公司加强应收账款的风险管控，积极催收应收账款，严控海外逾期应收账款和坏账。

2、公司建立了《金融衍生品交易业务管理制度》，对交易审批权限、内部审核流程、决策程序、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等做出明确规定。

3、公司开展金融衍生品交易业务严格遵循合法、审慎、安全、有效的原则，选择流动性强、风险可控的金融衍生品交易业务且只允许与具有合法经营资格的商业银行进行交易，不得进行投资和套利交易。

4、公司内部审计部门将会定期、不定期对实际交易合约签署及执行情况进行核查。

5、公司财务部负责对金融衍生品业务持续监控，定期向公司管理层报告。在市场剧烈波动或风险增大情况下，或导致发生重大浮盈、浮亏时第一时间报告给公司管理层以积极应对。

### **五、独立董事意见**

公司独立董事认为：公司开展金融衍生品业务以正常生产经营活动为基础，

以稳健为原则，以货币保值和规避汇率风险为目的，并且存在的潜在风险可控，符合《上海证券交易所股票上市规则》、公司章程等有关法律、法规和制度要求，且履行了必要的审批程序，不存在损害公司和全体股东利益的情形，因此，我们对该事项无异议。

#### 六、备查文件

- 1、江苏丰山集团股份有限公司第三届董事会第三次会议决议；
- 2、江苏丰山集团股份有限公司第三届监事会第三次会议决议；
- 3、江苏丰山集团股份有限公司独立董事对第三届董事会第三次会议相关事项的独立意见；

特此公告。

江苏丰山集团股份有限公司

董 事 会

2021年3月30日