

黑牡丹（集团）股份有限公司

关于 2022 年全资子公司开展远期结售汇业务的公告

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。

2022 年 4 月 22 日，黑牡丹（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）召开了九届六次董事会会议，审议通过了《关于 2022 年全资子公司开展远期结售汇业务的议案》，同意公司全资子公司黑牡丹纺织有限公司（以下简称“黑牡丹纺织”）及黑牡丹集团进出口有限公司（以下简称“黑牡丹进出口”）2022 年根据实际经营业务需要，在累计交易金额不超过 2,800 万美元的限额内开展远期结售汇业务，公司董事会同意授权公司经营管理层在上述额度范围内具体办理远期结售汇相关事项，授权期限为自公司九届六次董事会会议审议通过之日起一年内有效。该议案无须提交股东大会审议。具体情况公告如下：

一、开展远期结售汇业务的目的

鉴于黑牡丹纺织和黑牡丹进出口从国外采购部分原材料及部分产品直接出口国外市场，采用外币进行结算，外汇汇率波动对公司经营成果产生一定影响，因此，为使公司专注于生产经营，降低汇率波动对公司经营业绩的影响，黑牡丹纺织及黑牡丹进出口拟于 2022 年开展远期结售汇业务。

二、远期结售汇业务概述

远期结售汇业务是经中国人民银行批准的外汇避险金融产品，其交易原理是指与银行签订远期结售汇合同，约定将来办理结汇或售汇的外汇币种、金额、汇率和期限，在到期日发生外汇收入或支出时，按照该远期结售汇合同约定的币种、金额、汇率办理结汇或售汇业务，从而锁定当期结汇、售汇成本。

黑牡丹纺织及黑牡丹进出口拟开展的远期结售汇业务是为满足正常生产经营需要，以真实经营业务为依托，在银行办理的规避和防范汇率风险的业务；

只限于与进出口业务相关的结算外币，交割期间与进出口业务的执行期间相匹配，且金额与预测回款金额相匹配；不进行任何以逐利为目的的投机性、套利性交易操作。

三、远期结售汇业务额度及授权

根据黑牡丹纺织及黑牡丹进出口的实际业务需要，公司预计 2022 年拟开展的远期结售汇业务累计交易金额不超过 2,800 万美元。公司董事会同意授权公司经营管理层在上述额度范围内具体办理远期结售汇相关事项，授权期限为自公司九届六次董事会会议审议通过之日起一年内有效。

四、远期结售汇业务风险分析

公司开展的远期结售汇业务遵循锁定汇率风险、套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作，开展远期结售汇业务交易可以部分抵消汇率波动对公司的影响，但仍存在一定的风险：

1、汇率波动风险：在汇率行情变动较大的情况下，远期结售汇确认书约定的远期结售汇汇率可能偏离实际收付汇时的汇率，将可能造成公司汇兑损失。

2、客户违约风险：客户应收账款发生逾期，货款无法在预测的回款期内收回，会造成远期结汇无法按期交割导致公司损失。

3、回款预测风险：公司业务部门根据客户订单和预计订单进行回款预测，实际执行过程中，客户可能调整自身订单或由于客户所在地区的政治经济环境变化，造成公司回款预测不准，导致远期结汇延期交割风险。

4、内部控制风险：远期结售汇交易专业性较强，复杂程度高，可能会由于内控制度不够完善或执行不够到位而造成风险。

五、公司拟采取的风险控制措施

1、公司制定了《远期结售汇管理办法》，对远期结售汇业务的操作原则、审批程序、管理及操作规定、内部风险控制和信息披露作了明确规定。公司参与远期结售汇业务的人员都已充分理解远期结售汇业务的特点及风险，严格执行远期结售汇业务的操作规定和相关风险管理制度，确保开展远期结售汇业务的风险可控。同时，公司合规管理中心将审查和监督远期结售汇业务的实际运作情况，包括资金使用情况、盈亏情况、会计核算情况、制度执行情况等。

2、在签订远期结售汇合同时，公司将严格按照预测的收汇、付汇期和金额

进行交易，根据外汇汇率的变动趋势以及各金融机构报价信息，制订与实际业务规模相匹配的公司远期结售汇交易方案，将公司可能面临的风险控制在可承受范围以内。所有远期结售汇业务均有真实的业务背景，以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以规避和防范风险为目的，不进行单纯以盈利为目的的外汇交易，不进行投资和套利交易。

3、为防止远期结售汇延期交割，公司高度重视应收账款管理，及时掌握客户支付能力信息，加大跟踪催收应收账款力度，尽可能为出口货款购买信用保险，努力提高回款预测的准确性，尽量将该风险控制在最小的范围内。

4、公司只与经国家外汇管理局和中国人民银行批准、具有远期结售汇业务经营资格的金融机构进行远期结售汇业务交易，不与非正规的机构进行交易。

六、对公司的影响

开展远期结售汇业务是公司应对汇率波动风险采取的主动管理策略，公司以真实经营业务为依托，严格按照公司预测的收汇、付汇期和金额进行交易，不会对公司经营情况及财务状况产生重大不利影响。

七、独立董事意见

公司独立董事经对公司提交九届六次董事会会议审议的《关于 2022 年全资子公司开展远期结售汇业务的议案》进行认真审核后，就公司开展远期结售汇业务的事项发表如下独立意见：公司制定了《远期结售汇管理制度》，对远期结售汇业务的操作原则、审批程序、管理及操作规定、内部风险控制和信息披露作了明确规定；公司以真实经营业务为依托，以规避和防范风险为目的，不进行投资和套利交易；且只与经国家外汇管理局和中国人民银行批准、具有远期结售汇业务经营资格的金融机构进行远期结售汇业务交易；公司本次开展远期结售汇业务是公司应对汇率波动风险采取的主动管理策略，且风险可控，不会对公司经营情况及财务状况产生重大不利影响，符合公司及公司全体股东的利益，同意本次公司全资子公司开展外汇远期结售汇业务。

特此公告。

黑牡丹（集团）股份有限公司董事会

2022 年 4 月 26 日