证券代码：000876　　证券简称：新希望　　公告编号：2020-114

债券代码：127015　　债券简称：希望转债

新希望六和股份有限公司

关于开展保值型汇率和利率资金交易业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

新希望六和股份有限公司（以下简称“公司”）于 2020 年 8 月 27 日召开的第八届董事会第二十次会议以 8 票赞成，0 票反对，0 票弃权审议通过了《关于开展保值型汇率和利率资金交易业务的议案》。

随着公司外汇收入与支出的不断增长，收入与支出币种不匹配的现象日益突出；而2020年新冠疫情在全球蔓延，导致作为主要国际结算货币的美元成为避险币种，美元兑人民币及公司主要收入外汇币种在2020年上半年大幅升值；虽然近期美元指数下降，但美元兑公司各相关币种的较大幅波动仍然持续，致使公司涉外业务的外汇风险敞口扩大。

在利率方面，随着2019年中美贸易战持续升温，以及美国经济扩张周期接近尾声，美联储在2019年降息3次；进入2020年，美联储在2020年3月连续降息150基点，将美元借贷基准利率降低至历史最低点，并计划在可预见的未来保持较低的美联邦基金利率，来刺激美国经济复苏，而当前全球央行亦跟随美联储推行降息与增加货币投放量的宽松政策；未来随着新冠疫苗推出、疫情得以控制，预计各国央行仍然会回归利率正常化轨道。

为防范汇率及利率波动对公司利润和股东权益造成不利影响，公

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

司需要开展保值型汇率和利率的资金交易业务，以减少外汇与利率风险敞口。

公司及其全资子公司山东新希望六和集团有限公司、新希望新加坡私人有限公司以及四川新希望动物营养科技有限公司拟通过开展保值型汇率和利率资金交易业务，来降低汇率和利率波动对公司带来的不利影响。公司保值型资金交易业务以正常的进出口业务、外汇收入与支出及已有外币贷款为背景，资金交易金额和交易期限与收付款期限相匹配，并禁止从事任何投机套利行为。随着公司境外投资增加、跨境采购的资金量增加，导致外汇敞口扩大，公司拟通过更大额度来进行套期保值。公司2020年-2022年度拟进行的保值型资金交易对应标的（进出口额、外汇收支额或外币贷款额），在任意时点的余额不超过10亿美元，期限为董事会审议通过后24个月内。

一、保值型资金交易业务的品种

2020年-2022年度公司拟通过开展保值型汇率和利率的资金交易业务，以降低外汇与利率波动对公司带来的不利影响。保值型汇率和利率资金交易业务是指公司为减少实际经营活动中汇率与利率波动带来的对公司资产、负债和盈利水平的变动影响，利用金融机构提供的外汇和利率产品开展的以保值为目的的资金交易业务。外汇类业务主要涉及外汇远期、结构性远期，并辅之以外汇掉期和外汇期权等；利率类业务主要涉及利率掉期、结构性掉期，并辅之以利率期权等。

二、保值型资金交易业务的主要条款

1.合约期限：不超过六年

2.交易对手：银行类金融机构

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

3.流动性安排：保值型汇率和利率交易业务以正常的外汇收支业务或已有外币贷款为背景，投资金额和投资期限与预期收支期限相匹配。

4.其他条款：保值型汇率和利率交易业务主要使用公司的银行综合授信额度，到期采用本金交割或差额交割的方式。

三、保值型资金交易业务的管理

1.公司已制定《衍生品投资管理制度》，对公司进行资金交易等衍生品投资的风险控制、审议程序、后续管理等进行明确规定，以有效规范衍生品投资业务行为，控制衍生品投资风险。

2.由公司董事长、总裁、财务总监、海外BU及饲料供应链管理部负责人等组成保值型资金交易业务领导小组，明确资金交易业务工作小组的参与部门与人员岗位职责和权限。业务工作小组负责评估资金交易业务的风险分析，分析该业务的可行性与必要性，报董事长、总裁及业务领导小组审核批准后执行。业务工作小组配备投资决策、业务操作等专业人员，拟定资金交易业务计划并在董事会或股东大会授权范围内予以执行。

3.公司资金交易业务领导小组和业务工作小组应充分理解资金交易对应的衍生品投资的特点和潜在风险，严格执行衍生品投资的业务操作和风险管理制度。

四、保值型资金交易业务的风险分析

1.市场风险。保值型资金交易业务的合约汇率/利率与到期日实际汇率/利率的差异将产生投资损益；在保值型资金交易业务的存续期内，每一会计期间将产生重估损益，至到期日重估损益的累计值等

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

于投资损益。

2.流动性风险。保值型外汇资金交易业务以公司外汇收支预算为依据，与实际外汇收支相匹配，以保证在交割时拥有足额资金供清算，或选择净额交割衍生品，以减少到期日现金流需求；保值型利率资金交易业务均将按照利率差额的净额来进行交割。

3.履约风险。公司保值型资金交易业务交易对手均为信用良好且与公司已建立长期业务往来的银行，基本不存在履约风险。

4.其它风险。在开展业务时，如操作人员未按规定程序进行保值型资金交易业务操作或未充分理解衍生品信息，将带来操作风险；如交易合同条款的不明确，将可能面临法律风险。

五、保值型资金交易业务的风险管理策略

1.公司开展的保值型资金交易业务以减少汇率波动对公司影响为目的，禁止任何风险投机行为；公司保值型资金交易业务额不得超过经董事会或股东大会批准的授权额度上限；

2.公司业务工作小组在开展资金交易业务前需进行交易业务的风险分析，并拟定交易方案（包括资金交易品种、期限、金额、交易银行等）和可行性分析报告提交业务领导小组。

3.公司的保值型资金交易业务合约由业务工作小组提交财务总监、总裁及董事长审批后予以执行。

4.公司与交易银行签订条款准确清晰的合约，严格执行风险管理制度，以防范法律风险。

5.公司财务部门及时跟踪资金交易合约的公开市场价格或公允价值变动，及时评估已交易合约的风险敞口变化情况，并定期向董事

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

会风险控制委员报告；如发现异常情况，应及时上报董事会风险控制委员会，提示业务工作小组执行应急措施。

6.公司内部审计部门定期对资金交易合约进行合规性审计。

六、 保值型资金交易业务的会计核算政策及后续披露

1.公司开展的保值型资金交易业务的会计核算方法依据《企业会计准则》确定。

2.当公司已经交易的资金合约的公允价值减值与用于风险对冲的资产（如有）价值变动加总，导致合计亏损或浮动亏损金额占上市公司最近一期经审计净利润的10%以上，且绝对金额超过一千万元人民币时，公司业务工作小组将向董事会报告，公司将以临时公告及时披露。

3.公司将在定期报告中对已经开展的资金交易合约相关信息予以披露。

七、独立董事关于开展保值型汇率和利率资金交易业务的独立意见

随着公司外汇收入与支出的不断增长，收入与支出币种不匹配的现象日益突出，受2020年新冠疫情在全球蔓延及2019年中美贸易战持续升温等因素影响，公司收支的主要货币（主要指美元等）的汇率及利率波动幅度较大，因此公司需要开展保值型汇率和利率的资金交易业务，以减少外汇与利率风险敞口。

公司独立董事认为：公司拟开展的保值型汇率和利率资金交易业务，有助于防范汇率及利率波动对公司利润和股东权益造成的不利影

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

响，减少外汇与利率风险敞口，符合公司当前实际情况，有利于公司持续稳定发展，故同意公司本次业务事项。

八、保荐机构核查意见

公司本次开展保值型汇率和利率资金交易业务事项已履行了必要的程序，且经过董事会审议通过，独立董事发表了同意意见，符合《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》等法律、法规及规范性文件的要求和《公司章程》的规定，不存在损害公司和股东利益的行为。

招商证券股份有限公司对公司本次开展保值型汇率和利率资金交易业务事项无异议。

九、备查文件

1.公司第八届董事会第二十次会议决议；

2.公司独立董事关于公司 2020 年半年度报告及第八届董事会第二十次会议相关事项的独立意见；

3.关于开展保值型汇率和利率资金交易业务的可行性报告；

4. 招商证券股份有限公司关于新希望六和股份有限公司开展保值型汇率和利率资金交易业务的核查意见。

特此公告

新希望六和股份有限公司

董　事　会

二〇二〇年八月三十一日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn