

证券代码：601702

证券简称：华峰铝业

公告编号：2021-033

上海华峰铝业股份有限公司

关于继续开展外汇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。

上海华峰铝业股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）已于2021年9月17日召开第三届董事会第十二次会议、第三届监事会第七次会议审议并通过《关于继续开展外汇衍生品交易业务的议案》，同意本公司及控股子公司继续开展外汇衍生品交易业务，主要包括远期结售汇及相关组合业务，交易金额不超过人民币10亿元（或等值外币，在交易额度范围内可滚动使用）。自董事会批准之日起12个月内有效。

具体情况如下：

一、开展外汇衍生品交易的目的及必要性

随着公司进行全球化的业务布局，公司及控股子公司持有一定数量的外汇资产及外汇负债，为有效规避外汇市场风险，防范汇率大幅波动对公司造成不利影响，合理降低财务费用，公司及控股子公司拟继续开展外汇衍生品交易业务。

二、公司拟开展外汇衍生品交易业务品种

公司及控股子公司拟开展的外汇衍生品交易品种包括但不限于外汇远期交易、外汇掉期交易、外汇期权交易、人民币外汇远期交易、人民币外汇货币掉

期、人民币外汇期权交易、人民币对外汇期权组合等产品或上述产品的组合。衍生品的基础资产包括汇率、利率、货币、商品、其他标的；既可采取实物交割，也可采取现金差价结算；既可采用保证金或担保进行杠杆交易，也可采用无担保、无抵押的信用交易。

衍生品是指远期、互换、期权等产品或上述产品的组合。衍生品的基础资产包括汇率、利率、货币；既可采取实物交割，也可采取现金差价结算；只可采用无担保、无抵押的信用交易。本公告所称外汇衍生品交易是指满足正常生产经营需要，在银行办理的锁定成本、规避和防范汇率、利率风险的外汇衍生品交易业务，包括远期结售汇、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率期权、结构性远期等。

三、外汇衍生品交易管理

1、本次公司及控股子公司拟开展的外汇衍生品交易业务以减少汇率波动对公司的影响，杜绝投机行为。公司制定的《外汇衍生品交易管理办法》，已经由第三届董事会第七次会议审议通过，对拟进行的衍生品交易的相关审议程序、操作流程、风险控制等进行了明确规定。

2、本次外汇衍生品交易的额度及有效期

公司及控股子公司拟使用自有资金开展总金额不超过人民币10亿元（或等值外币）的外汇衍生品交易业务。自董事会批准之日起12个月内有效。有效期内，公司及控股子公司开展外汇衍生品交易业务，任意时点余额不超过人民币10亿元（或等值外币）。上述额度自董事会审批通过后12个月内可循环滚动使用，如单笔交易的存续期超过了授权期限，则授权期限自动顺延至该笔交易终止时止。前述投资不存在直接或间接使用募集资金从事该业务的情况。公司董事会授权经营层在此金额范围内根据业务情况、实际需要审批外汇衍生品交易业务申请。

本次拟开展的外汇交易业务已经公司第三届董事会第十二次会议审议通过，无须提交公司股东大会审议批准。

3、本次拟开展的外汇交易业务不涉及关联交易。

四、外汇衍生品交易的风险提示

1、市场风险

因国内外经济形势变化可能会造成汇率的大幅波动，远期外汇交易业务面临一定的市场风险。但对于单边的远期结汇或购汇业务，公司通过对外汇汇率走势的研究和判断，通过合约锁定结汇或售汇价格，有效降低了因汇率波动所带来的风险。

2、内部控制风险

基于远期结售汇交易专业性较强，复杂程度较高，开展业务时，相关业务人员未及时、充分地理解衍生品信息且未按规定操作程序进行，将会带来内部控制风险。

3、履约风险

在合约期限内合作银行出现倒闭等情形，导致公司不能以合约价格交割原有外汇合约。公司在选择开展外汇衍生品交易业务的合作银行时将选择实力雄厚、经营稳健的大型银行，以避免其倒闭所带来的违约风险。

五、外汇衍生品交易业务会计政策及核算原则

公司根据《企业会计准则第22号-金融工具确认和计量》、《企业会计准则第24号-套期会计》、《企业会计准则第37号-金融工具列报》等相关规定及其指南，对拟开展的外汇衍生品交易业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目。

六、独立董事意见

公司独立董事认为：基于公司进出口业务的不不断增加，需要大量外汇交易，

为规避和防范汇率波动风险，公司及控股子公司开展的外汇衍生品交易业务，切合公司实际发展需要，不存在损害公司全体股东、特别是中小股东利益的情形。公司董事会在审议上述议案时，相关审议程序符合法律、法规和规范性文件及《公司章程》的有关规定。

综上所述，我们一致同意公司及控股子公司继续开展外汇衍生品交易业务，主要包括远期结售汇及相关组合业务，交易金额不超过人民币10亿元（或等值外币，在交易额范围内可滚动使用）。自董事会批准之日起12个月内有效。

七、监事会意见

监事会认为：本次公司及控股子公司拟开展的外汇衍生品交易业务，根据公司实际业务需要提出，主要是为了规避和防范汇率波动风险，有效地保障公司及全体股东的利益。

因此，监事会同意公司及控股子公司在本次董事会批准额度范围内使用自有资金开展外汇衍生品交易业务。

八、备查文件

- 1、公司第三届董事会第十二次会议决议；
- 2、公司第三届监事会第七次会议决议；
- 3、独立董事《关于第三届董事会第十二次会议的独立意见》。

上海华峰铝业股份有限公司董事会

2021年9月17日