

# 浙江泰福泵业股份有限公司

## 关于公司 2023 年度外汇衍生品 交易计划的可行性分析报告

### 一、公司外汇衍生品交易计划的背景

由于浙江泰福泵业股份有限公司（以下简称“公司”）及控股子公司海外市场收入占比较高，为有效降低外汇市场风险，防范汇率大幅波动对公司造成不良影响，提高外汇资金使用效率，合理降低财务费用，公司对 2023 年度外汇衍生品交易制定了相应计划。

### 二、公司外汇衍生品交易计划概述

#### 1、交易目的

受国际宏观环境、经济形势等因素影响，外汇市场波动较为频繁，公司经营不确定因素增加。为降低和防范汇率风险，公司及控股子公司拟开展外汇衍生品交易业务，开展外汇衍生品交易业务将以正常业务为基础，合理安排资金使用，不进行单纯以投机为目的的外汇交易，不影响公司主营业务的发展。

#### 2、交易方式

公司及控股子公司拟开展的外汇衍生品交易业务涉及的外汇币种与公司生产经营所使用的主要结算外汇币种相同，主要外币币种包括但不限于美元、欧元、卢布等跟实际业务相关的币种。

#### 3、交易品种

远期结售汇、人民币和其他掉期业务、外汇期权及其他外汇衍生产品。

#### 4、交易场所

经国家外汇管理局和中国人民银行批准、具有外汇衍生品交易业务经营资格的金融机构。

#### 5、预计任一交易日持有的最高合约价值

不超过 8,000 万美元或其他等值外币。

#### 6、专业人员配备情况

公司组建了外汇衍生品交易领导小组，小组成员包括董事长、财务总监、内审部负责人等其他涉及到该业务的专业成员。

## 7、交易期限

自股东大会审议通过之日起 12 个月内有效，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。

## 8、资金来源

公司及控股子公司将使用自有资金开展衍生品交易业务。根据与金融机构签订的协议，公司及控股子公司可能需缴纳一定比例的保证金，或以金融机构对公司的授信额度来抵减保证金的要求。

## 9、审议程序

本次开展的外汇衍生品交易计划需经董事会战略发展委员会审查，董事会、监事会审议通过，由公司独立董事发表独立意见，由保荐机构发表核查意见，并经股东大会审议通过后实施。

## 10、实施方式

由股东大会授权董事长在股东大会批准的权限内负责外汇衍生品交易业务的具体运作和管理，并负责审核或由董事长授权他人审核相关协议及文件。

### 三、公司外汇衍生品交易计划的必要性和可行性

公司外汇衍生品交易计划是围绕公司实际外汇收支业务进行的，以具体经营业务为依托，以降低和防范汇率风险为目的，是出于公司稳健经营的需求，具有必要性。

公司已制定《外汇衍生品交易业务内部控制制度》，对外汇衍生品交易的操作原则、职责范围和审批权限、管理及内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等作出了明确规定，有利于进一步控制交易风险。该制度满足实际操作的需要，所制定的风险控制措施切实有效，开展外汇衍生品交易具有可行性。

### 四、公司外汇衍生品交易计划的投资风险分析

1、市场风险：因外汇行情变动较大，可能产生因标的利率、汇率等价格波动引起外汇交易产品价格变动，造成亏损的风险。

2、内部控制风险：外汇交易业务专业性较强，内控风险较高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。

3、回款预测风险：客户应收账款发生逾期、客户调整订单等情况将使货款

实际回款情况与预期回款情况不一致，可能使实际发生的现金流与已签署的外汇衍生品业务合同所约定期限或数额无法完全匹配，从而导致外汇延期交割风险。

4、法律风险：因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

### **五、公司外汇衍生品交易计划的风险控制措施**

1、为控制汇率大幅波动风险，公司将加强对汇率的研究分析，实时关注国际国内市场环境变化，适时调整经营、业务操作策略，最大限度地避免汇兑损失。

2、公司及控股子公司不进行单纯以投机和套利为目的的外汇衍生品交易，外汇衍生品交易行为均以保护公司正常销售利润率为目标，以具体经营业务为依托，以套期保值为手段，以降低和防范汇率风险为目的。

3、公司已制定外汇衍生品交易业务的内部控制制度，对外汇衍生品交易的操作原则、职责范围和审批权限、管理及内部操作流程、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等作出了明确规定，进一步控制交易风险。

4、公司将严格按照客户回款计划，控制外汇资金总量及结售汇时间。高度重视外币应收账款管理，尽量避免出现应收账款逾期的现象。

5、公司及控股子公司将审慎审查与金融机构签订的合约条款，严格执行制度，以防范法律风险。

### **六、公司外汇衍生品交易计划可行性分析结论**

公司外汇衍生品交易计划的相关决策程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。制定外汇衍生品交易计划是围绕公司实际外汇收支业务进行的，以具体经营业务为依托，以降低和防范汇率风险为目的，是出于公司稳健经营的需求，不存在损害公司和全体股东尤其是中小股东利益的情形。

综上所述，公司制定的外汇衍生品交易计划能够在一定程度上降低外汇市场的风险，防范汇率大幅波动对公司造成不良影响，提高外汇资金使用效率，合理降低财务费用，增强财务稳健性，具备可行性。

浙江泰福泵业股份有限公司

董事会

2023年4月25日