

股票代码：000301

股票简称：东方盛虹

公告编号：2024-030

债券代码：127030

债券简称：盛虹转债

江苏东方盛虹股份有限公司 关于开展外汇及利率衍生品交易业务的公告

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

重要内容提示：

- 1、交易目的：**通过开展外汇及利率衍生品交易降低汇率、利率波动影响，提升公司经营稳定性。
- 2、交易品种：**与自身生产经营所使用结算货币相关的外汇套期保值业务以及与融资利率相关的利率套期保值业务。
- 3、交易工具：**包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、外汇期权、外汇期货、货币掉期、利率互换、利率期权等。
- 4、交易场所：**银行等境内外金融机构。
- 5、投资金额：**投资期限内任一时点余额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）合计不超过35亿美元（其他币种按当期汇率折算成美元汇总）。
- 6、交易已履程序：**公司于2024年4月24日召开第九届董事会第十四次会议，以7票同意、0票反对、0票弃权的表决结果审议通过了《关于开展外汇及利率衍生品交易业务的议案》。此项交易尚需提交公司股东大会审议。
- 7、特别风险提示：**公司开展外汇及利率衍生品交易业务是为了更好地应对汇率和利率风险，锁定交易成本，降低经营风险，增强公司财务稳健性，不从事以投机为目的的衍生品交易，但同时也会存在一定的市场风险、操作风险、法律风险等。提醒投资者充分关注投资风险。

一、投资情况概述

1、投资目的

江苏东方盛虹股份有限公司（以下简称“公司”）进出口业务主要采用外币结算，受国际政治、经济不确定因素影响较大。在人民币汇率双向波动及利率市场化的金融市场环境下，为规避进出口业务和外币借款等所面临的汇率和利率风险，有必要开展外汇及利率衍生品交易业务。

基于公司商品进出口业务、外币贷款等外汇业务金额、相关业务经营周期等情况，结合公司的资金管理要求和日常经营需要，公司拟通过开展外汇及利率衍生品交易业务来化解经营及融资业务衍生的本外币资产和负债面临的汇率或利率风险。

2、投资金额

投资期限内任一时点余额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）合计不超过35亿美元（其他币种按当期汇率折算成美元汇总）。

3、交易方式

公司董事长组织建立领导小组，作为管理外汇及利率衍生品交易业务的决策机构，按照公司已制定的《衍生品交易管理制度》以及相关业务规则、流程进行操作。

公司将以正常外汇资产、负债为背景于境内及新加坡、中国香港开展外汇及利率衍生品交易，业务金额和业务期限与预期外汇收支期限相匹配，用以管理境内及新加坡、中国香港子公司的汇率及利率风险。投资种类包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、外汇期权、外汇期货、货币掉期、利率互换、利率期权等，交易对手为经国家外汇管理局和中国人民银行批准、或由所在国家、地区金融监管机构批准，具有外汇及利率衍生品交易业务经营资格的机构。

4、投资期限

投资期限自公司2023年度股东大会审议通过之日起至公司2024年度股东大会召开之日止。

二、审议程序

2024年4月24日，公司召开第九届董事会第十四次会议，审议并一致通过了《关于开展外汇及利率衍生品交易业务的议案》。基于公司商品进出口业务、外币贷款等外汇业务金额、相关业务经营周期等情况，预计公司及其控股子公司

2024年度开展外汇及利率衍生品交易业务，投资期限内任一时点余额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）合计不超过35亿美元（其他币种按当期汇率折算成美元汇总）。投资期限自公司2023年度股东大会审议通过之日起至公司2024年度股东大会召开之日止。

本事项尚需提交股东大会审议。本事项不涉及关联交易。

三、投资风险分析及风控措施

1、投资风险分析

公司开展外汇及利率衍生品交易业务是为了更好地应对汇率和利率风险，锁定交易成本，降低经营风险，增强公司财务稳健性，不从事以投机为目的的衍生品交易。公司已充分考虑结算便捷性、交易流动性、汇率波动性等因素以及相关国家和地区开展交易的政治、经济和法律等风险，但同时交易也会存在一定的风险。主要风险如下：

（1）市场风险：外汇及利率衍生品交易合约汇率、利率与到期日实际汇率、利率的差异将产生交易损益。在外汇及利率衍生品的存续期内，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于交易损益。

（2）操作风险：在开展外汇及利率衍生品交易业务时，如发生操作人员未按规定程序报备及审批，或未准确、及时、完整地记录交易业务信息，将可能导致衍生品业务损失或丧失交易机会。

（3）法律风险：在开展外汇及利率衍生品交易业务时，存在交易人员未能充分理解交易合同条款和产品信息，导致交易业务不符合法律规定或者产生外部法律纠纷事件从而造成企业损失。

2、风控措施

（1）开展外汇及利率衍生品交易业务以锁定成本、规避和防范汇率、利率风险为目的，禁止单纯以盈利为目的的投机、套利交易。

（2）制定相关业务规则及流程并严格执行，通过实行授权、岗位牵制和内部审计等措施进行风险控制。

（3）与具有合法资质的机构开展相关业务，并将审慎审查签订的相关合约

条款，以防范法律风险。

(4) 加强职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质，形成高效的风险处理程序。

四、对公司影响及相关会计处理

公司开展外汇及利率衍生品交易业务是为了实现稳健经营，有利于规避外汇市场的风险、降低外汇结算成本，不会对公司财务及经营状况产生不利影响，符合公司及全体股东的利益。

公司将根据财政部《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，对外汇及利率衍生品业务进行相应的核算处理，反映财务报表相关项目。

五、备查文件

1、公司九届十四次董事会决议。

特此公告。

江苏东方盛虹股份有限公司

董 事 会

2024年4月25日