

证券代码：603980

证券简称：吉华集团

公告编号：2024-068

## 浙江吉华集团股份有限公司

### 关于开展保值型衍生品投资业务的公告

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。

浙江吉华集团股份有限公司（以下简称“公司”）进出口业务需要大量的外汇交易，为规避汇率波动风险，公司第五届董事会第二次会议审议通过了《关于开展保值型衍生品投资业务的议案》，公司及控股子公司拟使用自有资金开展总额度不超过 5,000 万美元的外汇衍生品交易业务，在此额度内，可循环滚动使用。使用期限自董事会通过之日起 1 年内有效。

#### 一、衍生品投资概述

（一）合约期限：不超过一年

（二）合约金额：金额不超过 5,000 万美元

（三）交易对手：银行、券商等金融机构

（四）交易品种：金融机构提供的外汇远期、结构性远期、外汇掉期、外汇期权、利率掉期和结构性掉期及场外衍生品等业务

（五）流动性安排：衍生品投资以正常的外汇收支业务为背景，投资金额和投资期限与预期收支期限相匹配

（六）授权：自董事会通过之日起 1 年内有效，同时授权公司财务部具体实施相关事宜

#### 二、开展衍生品投资的必要性

公司开展的衍生品投资业务与日常经营需求紧密相关，随着公司国际贸易业务的不断增长，收入与支出币种的不匹配致使以美元和欧元为主的外汇风险敞口不断扩大，为防范汇率波动对公司利润和股东权益造成不利影响，公司需进行衍生品投资，以减少外汇风险敞口。

#### 三、衍生品投资的管理

（一）公司开展的衍生品投资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。

（二）公司已制定《衍生品投资管理制度》，对公司进行衍生品投资的风险

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行为，控制衍生品投资风险。

（三）公司成立了衍生品投资工作小组，具体负责公司衍生品投资事务。投资工作小组配备投资决策、业务操作、风险控制等专业人员。

（四）公司投资工作小组成员应充分理解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。

#### 四、衍生品投资的风险分析

（一）市场风险：衍生品投资合约汇率与到期日实际汇率的差异将产生投资损益；在衍生品的存续期内，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投资损益。

（二）流动性风险：衍生品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。

（三）履约风险：公司衍生品投资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、券商等大型机构，基本不存在履约风险。

（四）其他风险：在开展业务时，如操作人员未按规定程序进行衍生品投资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。

特此公告。

浙江吉华集团股份有限公司

董事会

2024年8月28日