

山东玻纤集团股份有限公司

关于开展远期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法律责任。

重要内容提示：

● 交易主要情况

交易目的	☐ 获取投资收益 ☒ 套期保值（合约类别： ☐ 商品； ☒ 外汇； ☐ 其他：_____） ☐ 其他：_____	
交易品种	包括但不限于远期结售汇、结构性远期、外汇互换、外汇期货、外汇期权、外汇掉期业务及其他外汇衍生产品等业务。	
交易金额	预计动用的交易保证金和权利金上限（单位：万元）	1250
	预计任一交易日持有的最高合约价值（单位：万美元）	3000
资金来源	☒ 自有资金 ☐ 借贷资金 ☐ 其他：____	
交易期限	自股东会审议通过之日起12个月内。	

● 已履行及拟履行的审议程序

山东玻纤集团股份有限公司（以下简称公司）于2026年8月18日召开第四届董事会审计委员会第十四次会议、第四届董事会第二十二次会议，审议通过了《关于开展远期外汇衍生品交易业务的议案》，本事项尚需提交公司股东会审议。

● 特别风险提示

公司及子公司开展远期外汇衍生品交易业务以套期保值为目的，遵循合法、谨慎、安全和有效的原则。但远期外汇衍生品交易业务仍存在一定的汇率波动风险、内部控制风险、交易违约风险、回款预测风险等其他风险，敬请广大投资者

注意投资风险。

一、交易情况概述

（一）交易目的

随着公司业务版图的拓展与战略布局的推进，海外业务增速显著，外汇收入规模持续攀升。为有效规避外汇市场风险，防范汇率大幅波动对公司经营的不利影响，提升外汇资金使用效率，公司及子公司拟开展远期外汇衍生品交易业务，以加强外汇风险管理，满足公司稳健经营的需求。

公司及子公司拟开展的远期外汇衍生品交易以套期保值为目的，遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不影响公司正常生产经营，不进行投机和套利交易。

（二）交易金额

公司及子公司拟开展的远期外汇衍生品交易业务，任一交易日持有的最高合约价值(即交易资金额度)不超过 3,000 万美元或等值外币。预计动用的交易保证金和权利金上限(包括为交易而提供的担保物价值、预计占用的金融机构授信额度、为应急措施所预留的保证金等)不超过人民币 1,250 万元(或等值其他货币)。该额度在审批有效期内可循环使用，且任一时点的持有余额(含前述交易收益再交易的相关金额)不得超出上述额度。

（三）资金来源

公司及子公司开展远期外汇衍生品交易业务的资金为自有资金，不涉及募集资金。

（四）交易方式

公司及子公司将与经国家外汇管理局和中国人民银行批准，具有远期外汇衍生品交易业务经营资格的金融机构开展远期外汇衍生品交易业务。公司及子公司的远期外汇衍生品交易业务只限于从事与公司及子公司生产经营所使用的主要

结算货币相同的币种，主要外币币种有美元等。拟开展的远期外汇衍生品交易业务品种包括但不限于远期结售汇、结构性远期、外汇互换、外汇期货、外汇期权业务及其他外汇衍生产品等业务。

（五）交易期限

交易期限为自公司董事会审议通过之日起 12 个月内。

二、 审议程序

公司于 2026 年 8 月 18 日召开第四届董事会审计委员会第十四次会议，以 3 票同意、0 票反对、0 票弃权审议通过《关于开展远期外汇衍生品交易业务的议案》，并同意将该议案提交公司董事会审议。同日，公司召开第四届董事会第二十二次会议，以 9 票同意、0 票反对、0 票弃权、0 票回避审议通过《关于开展远期外汇衍生品交易业务的议案》。本事项尚需提交公司股东会审议。

本次公司及子公司拟开展的远期外汇衍生品交易业务不涉及关联交易。

三、交易风险分析及风控措施

（一）交易风险分析

公司及子公司开展远期外汇衍生品交易业务可以在汇率发生大幅波动时，降低汇率波动对公司及子公司的影响，但同时该业务也会存在一定风险：

1. 汇率波动风险：在外汇汇率走势与公司及子公司判断汇率波动方向发生大幅偏离的情况下，若远期结售汇确认书约定的远期结售汇汇率低于实时汇率时，将造成汇兑损失。

2. 内部控制风险：远期外汇衍生品交易专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内控制度不完善而造成风险。

3. 交易违约风险：远期外汇衍生品交易业务交易对手出现违约，不能按照约定支付公司及子公司套期保值盈利从而无法对冲公司及子公司实际的汇兑损失，将造成公司及子公司损失。

4. 回款预测风险：公司及子公司根据采购订单、客户订单和预计订单进行付款、回款预测，但在实际执行过程中，客户可能会调整自身订单和预测，造成公司及子公司回款预测不准确，导致公司及子公司已操作的远期外汇衍生品交易业务产生延期交割风险。

（二）公司采取的风险控制措施

1. 遵循锁定汇率风险、套期保值的原则，不做投机性、套利性的交易操作，在签订合约时严格按照公司及子公司预测回款期限和回款金额进行交易。

2. 选择结构简单、流动性强、固定收益型低风险的外汇衍生品交易业务，交易机构选择具备资质且信用度较高的银行等金融机构。

3. 公司及子公司外汇衍生品业务相关人员加强对远期外汇衍生品交易业务的特点及风险的学习与培训，严格执行远期外汇衍生品交易业务的操作和风险管理制度，授权部门和人员应当密切关注和分析市场走势，持续跟踪远期外汇公开市场价格或公允价值变动，及时评估远期外汇衍生品交易的风险敞口变化情况，结合市场情况，适时调整操作策略，提高保值效果。

4. 公司制定了《外汇衍生品套期保值管理制度》，明确规定了公司及子公司开展远期外汇衍生品交易的操作原则、审批权限、责任部门及责任人、内部操作流程、内部风险报告制度及风险处理程序，充分控制交易风险。

5. 公司经营管理部（审计）定期对远期外汇衍生品交易进行合规性检查。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司本次开展外汇衍生品交易业务以具体经营业务为依托，旨在降低或规避汇率风险，减少汇兑损失，控制经营风险，从而增强公司财务稳健性，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。

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，对外汇衍生品交易业务进行相应的核算与会计处理。

套期保值业务是否符合《企业会计准则第 24 号——套期会计》适用条件	☒ 是 ☐ 否
拟采取套期会计进行确认和计量	☒ 是 ☐ 否

特此公告。

山东玻纤集团股份有限公司董事会

2026 年 8 月 19 日