

股票代码：000301

股票简称：东方盛虹

公告编号：2023-041

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 关于开展商品套期保值业务的公告

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、投资种类：原油、石脑油、成品油、对二甲苯(PX)、精对苯二甲酸(PTA)、乙二醇(MEG)、甲醇、液化石油气(LPG)、苯乙烯等产业链相关商品的交易合约。

2、投资金额：投资期限内任一时点保证金余额(含前述投资的收益进行再投资的相关金额，不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内)合计不超过人民币35亿元（其他币种按当期汇率折算成人民币汇总）。

3、特别风险提示：公司开展商品套期保值业务不以投机为目的，投资品种仅限于与公司生产经营相关的产品或者所需的原材料，以规避价格波动给公司经营带来的不利影响，降低经营风险，但同时也会存在一定的风险。提醒投资者充分关注投资风险。

一、投资情况概述

1、投资的目的

江苏东方盛虹股份有限公司（以下简称“公司”）主要经营石油及化工产品、化学纤维产品的生产与销售业务，其价格受国际和国内价格的影响较大。为规避原油及产品价格的大幅波动给公司经营带来的不利影响，结合生产经营计划，公司拟开展商品套期保值业务，充分利用期货市场功能以及新加坡、中国香港完善的金融衍生品交易市场进行套期保值，降低生产运营风险，提升企业经营水平，保障企业健康持续运行。

2、投资金额

投资期限内任一时点保证金余额(含前述投资的收益进行再投资的相关金额,不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内)合计不超过人民币35亿元(其他币种按当期汇率折算成人民币汇总)。

3、投资方式

公司董事长组织建立领导小组,作为管理商品套期保值业务的决策机构,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。

公司拟于境内及新加坡、中国香港开展与公司生产经营相匹配的商品套期保值交易,投资种类为原油、石脑油、成品油、对二甲苯(PX)、精对苯二甲酸(PTA)、乙二醇(MEG)、甲醇、液化石油气(LPG)、苯乙烯等产业链相关商品的交易合约。投资选择的交易场所和交易品种市场公开透明,成交积极活跃,流动性较强。

4、投资期限

投资期限自公司2022年度股东大会审议通过之日起至公司2023年度股东大会召开之日止。

5、资金来源

本次用于投资的资金来源为公司自有资金,无涉及使用募集资金或银行信贷资金。

二、审议程序

2023年4月16日,公司以通讯表决方式召开第九届董事会第二次会议,审议并一致通过了《关于开展商品套期保值业务的议案》。根据生产经营计划,本着谨慎原则,预计公司及其控股子公司2023年度开展商品套期保值业务,投资期限内任一时点保证金余额(含前述投资的收益进行再投资的相关金额,不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内)合计不超过人民币35亿元(其他币种按当期汇率折算成人民币汇总)。投资期限自公司2022年度股东大会审议通过之日起至公司2023年度股东大会召开之日止。公司独立董事对本事项发表了表示同意的独立意见。

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

公司开展商品套期保值业务不以投机为目的，投资品种仅限于与公司生产经营相关的产品或者所需的原材料，以规避价格波动给公司经营带来的不利影响，降低经营风险。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：在行情变动急剧时，公司可能无法完全实现锁定原油或产品价格，造成损失。

（2）流动性风险：公司制定相关业务规则及流程，在规定的权限内下达操作指令，如市场波动过大，可能导致因来不及补充保证金而被强行平仓所带来的实际损失。

（3）操作风险：由于期货及远期交易专业性较强，复杂程度较高，会存在因信息系统或内部控制方面的缺陷而导致意外损失的可能。

（4）信用风险：当价格出现对交易对方不利的大幅度波动时，交易对方可能违反合同的相关规定，取消合同，造成公司损失。

（5）法律风险：因相关法律制度发生变化或交易对方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。

2、风控措施

（1）开展商品套期保值业务以规避商品价格风险为目的，将套期保值业务与公司经营业务相匹配，对冲原料及产品价格波动风险。

（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）设立符合要求的计算机系统及相关设施，确保交易工作正常开展。当发生故障时，及时采取相应的处理措施以减少损失。

(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、投资对公司的影响

公司开展商品套期保值业务是为了实现稳健经营，有利于提高公司抵御市场价格波动风险的能力，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，对套期保值业务进行相应的核算处理，反映财务报表相关项目。

五、独立董事意见

1、本次董事会的召集、召开符合相关法律、行政法规和《公司章程》的规定。

2、公司已建立健全相关内控制度，通过加强内部管理，落实风险防范措施，控制衍生品投资风险；公司开展商品套期保值业务符合实际经营的需要，可以在一定程度上规避原油及产品价格波动风险，降低生产运营风险，不存在损害公司及全体股东特别是中小股东利益的情形。

我们同意公司开展商品套期保值业务事项，并将议案提交股东大会审议。

六、备查文件

- 1、公司九届二次董事会决议；
- 2、公司独立董事独立意见。

特此公告。

江苏东方盛虹股份有限公司

董 事 会

2023年4月17日