

## 华孚时尚股份有限公司

### 关于预计 2023 年度参与期货套保交易事项的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

#### 一、公司参与期货套保交易的情况概述

华孚时尚股份有限公司（以下简称“公司”）2023 年拟对棉花和棉纱期货进行交易，根据市场和公司经营情况，预计公司 2023 年度开展期货套保交易的保证金最高额度不超过人民币 15 亿元。在该额度范围内资金可滚动使用。

套保期货品种：纽约期货交易所（NYBOT）的棉花合约、郑州商品期货交易所交易的棉花合约和棉纱合约等与公司生产经营有关的相关品种。

上述期货套保交易事项已经公司 2023 年 4 月 27 日召开的第八届董事会第四次会议以 9 票赞成，0 票反对，0 票弃权的表决结果审议通过，该事项尚需提交公司股东大会审议。有效期为公司股东大会审议通过该事项之日起 12 个月。

#### 二、公司参与期货套保交易的必要性及可行性

公司拟参与期货套期保值交易的品种为公司生产经营中主要使用的棉花原材料和棉纱，参与上述品种的期货套保交易是以规避生产经营中原材料价格波动所带来的风险为目的，不进行投机和套利交易。公司参与期货市场交易，与现货市场交易相结合，将有效拓宽采购渠道，锁定原材料成本，有利于公司规避棉花价格波动的风险，保持公司经营业绩的稳定性和可持续性。公司将严格按照《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 7 号——交易与关联交易》和公司《对外投资管理制度》的要求，落实风险防范措施，审慎操作。

综上所述，公司开展商品期货套期保值业务是切实可行的，对公司的生产经营是有利的，不会损害公司及公司股东的利益。

#### 三、公司参与期货套保交易的准备情况

公司已根据《深圳证券交易所上市公司自律监管指引第 7 号——交易与关联

交易》及公司《对外投资管理制度》，对期货套保交易的组织机构、授权制度、交易计划、交易管理、档案管理、保密制度、信息披露和会计政策等作出了规定。参与期货套保交易的人员均为专业人士，充分理解拟交易期货品种的特点及风险。

#### **四、期货套保交易的风险分析**

（一）法律风险：因相关法律制度发生重大变化可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。如果公司选择的期货公司在交易过程中存在违法违规经营行为，也可能给公司带来损失。

（二）市场风险：由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，价格微小的变动就可能会使公司权益遭受损失。

（三）操作风险：行情系统、下单系统等可能出现技术故障，导致无法获得行情或无法下单；或者由于操作人员出现操作失误，都可能会造成损失。

（四）流动性风险：当公司无法及时补足保证金时，可能会被强制平仓而遭受损失。

（五）信用风险：交易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。

#### **五、风险管理策略的说明**

公司参与期货套保交易是为了开拓采购和销售渠道，规避价格波动带来的风险。

公司将严格按照公司《对外投资管理制度》的规定来安排计划、审批、指令下达、操作、稽查、审计等环节并进行相应的风险控制和管理。

#### **六、期货公允价值分析**

公司期货套保交易品种均在场内的郑州商品期货交易所和纽约商品交易所等交易，市场透明度大，成交活跃，成交价格和当日结算单价能充分反映衍生品的公允价值。

#### **七、会计政策及核算原则**

公司期货套保交易相关会计政策及核算原则按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则》及相关规定执行。

## 八、审议程序

公司于2023年4月27日召开第八届董事会第四次会议和第八届监事会第十二次会议，审议通过《预计2023年度参与期货套期保值交易事项的议案》，该事项尚需提交至公司股东大会审议，有效期为公司股东大会审议通过该事项之日起12个月。

## 九、独立董事独立意见

根据《上市公司独立董事规则》和《公司章程》的有关规定，公司独立董事就公司参与期货套保交易发表以下独立意见：

公司使用自有资金参与期货套保交易的相关审批程序符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定。公司已就参与期货套保交易建立了健全的组织机构及《对外投资管理制度》。公司期货套保交易仅限于与企业正常生产经营所使用的原材料棉花及棉纱，且交易目的是锁定原材料价格波动风险，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

综上所述：我们认为公司将期货交易作为拓宽采购与销售渠道的途径以及规避原材料价格波动风险的有效工具，通过加强内部控制和管理，落实风险防范措施，提高经营水平，有利于公司实现持续稳定的经营效益。公司参与期货套保交易是必要的，风险是可以控制的。我们一致同意该事项。

## 十、备查文件

- 1、公司第八届董事会第四次会议决议；
- 2、公司第八届监事会第十二次会议决议；
- 3、独立董事关于公司第八届董事会第四次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

华孚时尚股份有限公司董事会

二〇二三年四月二十九日