



证券代码:000850

证券简称:华茂股份

公告编号:2023-011

安徽华茂纺织股份有限公司 关于开展金融衍生品业务的公告

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

重要内容提示:

- 1、投资种类:金融机构提供的远期结售汇、外汇期权、外汇掉期、利率互换、利率掉期、货币互换、棉花和铜等商品期货套期保值业务。
- 2、投资金额:不超过3.5亿元人民币(或等值的其他货币)。
- 3、特别风险提示:可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动而造成金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险;可能会由于内部控制机制不完善而造成风险;可能因市场流动性不足而无法完成交易的风险;可能存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险;可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

一、金融衍生品交易业务情况概述

安徽华茂纺织股份有限公司(以下简称“公司”)于2023年4月27日召开第八届董事会第十九次会议审议通过了《关于开展金融衍生品交易业务的议案》,同意公司及全资、控股子公司开展总金额不超过3.5亿元人民币(或等值的其他货币,占公司2022年度经审计归属于上市公司股东的净资产的7.8%)的金融衍生品交易业务,期限自董事会审议通过之日起12个月内,上述额度在审批期限内可循环滚动使用。同意授权董事长或由其授权人在上述额度范围内,审批公司日常金融衍生品交易具体操作方案、签署相关协议及文件。本次金融衍生品交易事项不涉及关联交易,属于公司董事会决策权限,无需提交股东大会审议。具体情况如下:

1、投资目的

为有效规避和防范汇率、利率波动风险,合理控制汇兑损益风险对公司经营业绩的影响,同时为规避产品价格波动对公司生产经营造成的潜在风险,充分利用期货、期权等市场的套期保值功能,减少因原料价格、产品价格波动造成的产品成本波动,保证产品毛利的相对稳定,公司及子公司拟开展以套期保值为目的的金融衍生品交易业务。

2、投资额度、期限及授权

公司拟开展总金额不超过3.5亿元人民币(或等值的其他货币)的金融衍生品交易业务,期限自董事会审议通过之日起12个月内,上述额度在审批期限内资本金可循环使用。同时,授权董事长或由其授权人在前述额度范围和审批有效期内行使金融衍生品交易业务的投资决策权并签署相关文件,由公司财务部门或公司指定的部门负责具体实



施事宜。

3、交易品种

金融机构提供的远期结售汇、外汇期权、外汇掉期、利率互换、利率掉期、货币互换、原材料、产品（棉花、铜）商品期货套期保值业务等。

4、资金来源

公司及全资、控股子公司暂时闲置自有资金。

二、金融衍生品交易业务风险分析及风控措施

（一）投资风险

公司开展金融衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不得进行投机性和单纯的套利交易，但金融衍生品交易操作仍存在一定的风险，主要包括：

1、价格波动风险

可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动而造成金融衍生品价格变动而造成亏损的市场风险。

2、内部控制风险

金融衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于内部控制机制不完善而造成风险。

3、流动性风险

因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

4、履约风险

开展金融衍生品业务存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。

5、法律风险

因相关法律发生变化或交易对手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。

（二）风控措施

1、选择结构简单、流动性强、风险可控的金融衍生工具开展套期保值业务。

2、公司已制订《金融衍生品交易管理制度》，所有金融衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，以真实的交易背景为依托，以规避和防范风险为目的。制度就公司业务基本原则、审批权限、管理及工作流程、内部风险控制措施与会计政策等做出了明确规定，该制度符合监管部门的有关要求，满足实际操作的需要，所制定的风险控制措施切实有效。

3、公司金融衍生品各管理部门均有清晰的管理定位和职责，并且责任落实到人，通过分级管理，从根本上杜绝了单人或单独部门操作的风险，在有效地控制风险的前提



下也提高了对风险的应对速度。

4、公司与具有合法资质的商业银行开展金融衍生品交易业务，密切跟踪相关领域的法律法规，规避可能产生的法律风险。

三、对公司的影响及可行性分析

（一）对公司的影响

公司在充分保障日常经营性资金需求、不影响正常经营活动并有效控制风险的前提下，使用部分自有资金开展金融衍生品交易业务，有利于提高公司应对外汇波动风险的能力，防范汇率波动带来对公司经营带来的不利影响；有利于规避产品价格波动对公司生产经营造成的潜在风险，充分利用期货、期权等市场的套期保值功能，减少因产品价格波动造成的产品成本波动，保证产品毛利的相对稳定。

（二）可行性分析

公司拟开展的衍生品业务以及所涉及的品种，均匹配公司业务，充分利用外汇衍生交易、原材料、产品（棉花、铜）期货交易的套期保值功能，对冲经营活动中的汇率风险和产品价格波动影响，降低汇率波动和产品价格波动对公司的影响。此外，公司已建立完善的《金融衍生品交易管理制度》并明确风险应对措施，业务风险可控，不存在损害公司和股东利益的行为。

四、独立董事的独立意见

公司独立董事认为：公司目前经营情况良好，财务状况稳定，开展金融衍生品交易业务有利于公司稳健经营，规避市场的风险、降低结算成本；该业务不会影响公司日常资金正常周转需要和公司主营业务的正常发展，符合公司和全体股东的基本利益，不存在损害公司及全体股东、特别是中小股东利益的情形；公司已制定《金融衍生品交易管理制度》，能够有效规范金融衍生品投资行为，控制金融衍生品交易风险。一致同意公司开展金融衍生品交易业务事项。

五、备查文件

- 1、公司第八届董事会第十九次会议决议；
- 2、公司独立董事关于公司八届十九次董事会相关事项的独立意见。

特此公告。

安徽华茂纺织股份有限公司 董事会

二〇二三年四月二十九日