证券代码：000045、200045　证券简称：深纺织A、深纺织B　公告编号：2026-48

深圳市纺织（集团）股份有限公司
关于子公司开展外汇套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要内容提示：

1、交易目的：深圳市纺织（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）之控股子公司深圳市盛波光电科技有限公司（以下简称“盛波光电”）为了有效控制外汇汇率波动对其经营业绩带来的不确定影响，增强财务稳健性，拟开展外汇套期保值业务。

2、交易工具和交易品种：可选择的交易工具包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、货币期权等监管许可的外汇衍生工具，所有品种的使用均以对冲对应币种的汇率波动风险为唯一目标，不进行任何投机套利类操作。盛波光电外汇套期保值业务的交易币种以日元为核心，美元作为配套补充，所有币种的套保规模均严格对应真实跨境贸易的收支敞口，不开展无实需背景的币种交易。

3、交易场所：具有经国家金融监管部门批准、具备外汇衍生品合法经营资质的银行等金融机构。

4、交易金额：交易合计金额不超过人民币 20 亿元或等值外币，且在任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）将不超过前述额度，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 2 亿元或等值外币。

5、审议程序：公司于 2026 年 11 月 27 日召开第九届董事会第十次会议审议通过了上述事项。本事项尚需提交公司股东会审议，不构成关联交易。

6、风险提示：盛波光电本次开展外汇套期保值业务不以投机为目的，无本金或收益保证，在交易业务操作过程中存在外汇波动风险、内部控制风险、履约

风险及法律风险，敬请投资者注意投资风险。

一、投资情况概述

（一）投资目的

盛波光电生产所需主要原材料以进口为主，采购交易币种主要为日元和美元。为有效控制汇率波动对盛波光电经营业绩带来的不确定影响，增强财务稳健性，有必要开展外汇套期保值业务，对外汇风险敞口进行管理。用于套期保值的外汇衍生品与需管理的相关风险敞口存在相互风险对冲的经济关系，使得相关外汇衍生品与相关风险敞口的价值因面临相同的风险因素而发生方向相反的变动，以达到成本锁定、降低风险的套期保值目的。

（二）交易金额

交易合计金额不超过人民币 20 亿元或等值外币，且在任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）将不超过前述额度，资金可以在有效期内使用。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 2 亿元或等值外币。

（三）交易方式

交易场所为具有经国家金融监管部门批准、具备外汇衍生品合法经营资质的银行等金融机构。交易品种包括但不限于远期结售汇、外汇掉期、货币期权等监管许可的外汇衍生工具。盛波光电外汇套期保值业务的交易币种以日元为核心，美元作为配套补充，所有币种的套保规模均严格对应真实跨境贸易的收支敞口，不开展无实需背景的币种交易。

（四）交易期限

公司股东会审议通过之日起不超过 12 个月。

（五）资金来源

盛波光电开展外汇套期保值业务的资金均为自有资金。

二、审议程序

公司于 2026 年 11 月 27 日召开第九届董事会第十次会议审议通过了《关于子公司开展外汇套期保值业务的议案》。该项议案在提交公司董事会审议前，已经公司董事会审计委员会审议通过。

本次拟开展的外汇套期保值业务不涉及关联交易。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》等相关法律法规和规范性文件的规定，盛波光电本次拟开展的外汇套期保值业务在公司董事会审议通过之后，尚需提交公司股东会审议。

三、交易风险分析及风控措施

（一）风险分析

盛波光电开展外汇套期保值业务以对冲主业汇率敞口为核心目的，不涉及任何投机套利类交易，但业务开展过程中仍存在以下潜在风险：

1、汇率异动风险：若汇率市场出现大幅波动，银行远期结售汇报价与盛波光电实际收付汇时点的即期汇率出现阶段性偏离，可能导致套保对冲效果不及预期，产生汇兑损失。

2、交易履约风险：尽管盛波光电仅选择高信用等级的合作机构，但若市场出现极端流动性事件，仍可能存在合约到期无法正常交割的潜在履约风险。

3、合规法律风险：若外汇衍生品相关监管法规出现调整，或交易对手合约条款存在合规瑕疵，可能影响套保合约的正常执行，给盛波光电带来不必要的损失。

4、内部控制风险：外汇套期保值业务专业性较强、复杂程度较高，若内控制度不完善、操作流程执行不到位，可能出现超权限交易、产品选择与实需敞口不匹配等问题，进而引发非必要的操作风险。

（二）风险控制措施

针对上述风险，拟采取措施如下：

1、仅与国内头部持牌大型银行开展合作，签约前核查对方外汇衍生品业务资质，合约条款明确交割时间、履约保障机制，从源头规避极端流动性下的交割异常问题。

2、业务开展前同步确认最新外汇监管规则，签约前由法务岗核查合约条款合规性，所有操作严格匹配公司制度要求，避免因规则变动或条款瑕疵影响合约正常执行。

3、每日跟踪汇率行情，结合未来 3 个月的收付汇敞口动态微调套保比例，不盲目追高或过度锁汇，将套保对冲偏差控制在合理区间内，避免汇兑损失超出预期。

4、严格执行外汇套期保值业务岗位权责完全分离机制，从制度层面杜绝单人全流程操作的内控漏洞，所有岗位权责互不交叉、互为校验，所有套保交易必须执行分级审批流程，从机制上彻底杜绝超权限交易、产品与实需敞口不匹配的操作风险。

5、公司审计部为外汇套期保值业务的监督部门，负责审查监督外汇套期保值业务的实际操作情况、资金使用情况及盈亏情况等，督促财务部及时进行账务处理，并对账务处理情况进行核实。

6、公司财务部作为外汇套期保值业务的业务督导部门，负责加强对外汇套期保值业务开展情况的业务督导，跟踪核查业务执行进度、资金使用情况及账务处理情况，促进业务规范开展及风险防范。

四、交易相关会计处理及对公司的影响

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》相关配套指南要求，对外汇套期保值业务进行规范核算与信息披露，相关业务影响将如实体现在资产负债表、利润表以及现金流量表对应项目中。

盛波光电从事上述套期保值业务是在保证正常生产经营的前提下，根据市场情况，利用外汇套期保值工具的套期保值功能和避险机制，更好地规避和防范外汇汇率大幅波动风险，符合业务发展需求，有助于增强财务稳健性，控制经营风险，实现公司稳健经营的目标，不存在损害公司和全体股东利益的情形。

五、备查文件

1、第九届董事会第十次会议决议；

2、第九届董事会审计委员会第四次会议纪要；

3、关于开展外汇套期保值的可行性分析报告；

4、关于开展外汇套期保值业务风险控制预案；

5、公司《外汇套期保值业务管理制度》。

特此公告

深圳市纺织（集团）股份有限公司

董　事　会

二〇二六年十一月二十八日