

证券代码：605189

证券简称：富春染织

公告编号：2022-090

转债代码：111005

转债简称：富春转债

## 芜湖富春染织股份有限公司 关于开展境外套期保值业务的公告

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个别及连带责任。

### 重要内容提示：

●交易种类：芜湖富春染织股份有限公司（以下简称“公司”）及子公司拟开展的境外套期保值业务（以下简称“期货套保”）仅限于与公司生产经营相关的原材料，包括但不限于棉花。

●资金额度：公司开展境内外套期保值业务保证金总额不超过人民币10,000万元（含10,000万元，但不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内）。

●履行的审议程序：公司于2022年11月3日召开第三届董事会第六次会议，审议通过《关于开展境外套期保值业务的议案》，该议案无需提交股东大会审议。

●特别风险提示：公司及子公司开展套期保值业务，以合法、谨慎、安全和有效为原则，不以套利、投机为目的，主要是用来规避由于原材料价格的波动所带来的风险，但套期保值业务操作也存在一定的风险，敬请投资者注意投资风险。

### 一、套期保值业务情况概述

#### （一）开展境外套期保值业务的目的

公司在生产经营中部分棉花原材料和产成品色纱，需要通过境外采购及销售，为规避境外采购销售过程中，棉花价格波动给公司生产经营带来的不利影响，控制经营风险，充分利用期货期权的套期保值功能，公司拟以自有资金开展境外期货期权套期保值业务，有效控制原材料价格波动风险，不进行投机和套利交易，有利于提升公司整体抵御风险能力，增强财务稳健性。

#### （二）期货套保的基本情况

1、拟投资的期货期权品种：公司套期保值期货品种限于境内外期货交易所挂牌交易的与公司生产经营相关的期货（期权）品种合约，包括但不限于棉花和棉纱。

2、交易额度、期限及授权：公司开展境内外期货套期保值业务保证金总额不超过人民币 10,000 万元（含 10,000 万元，但不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内）。上述额度自公司董事会审议通过之日起 12 个月内有效，在审批期限内可循环使用，即任一时点的交易金额不超过上述额度。董事会授权董事长及相关人士在上述额度范围内具体签署套期保值业务相关协议及文件。

3、资金来源：期货资金来源为公司自有资金，不存在使用募集资金的情形。

## 二、审议程序

公司于 2022 年 11 月 3 日召开第三届董事会第六次会议，会议审议通过了《关于开展境外套期保值业务的议案》，同意公司及子公司开展境外套期保值业务，交易品种仅限于与公司生产经营相关的原材料，包括但不限于棉花。公司开展境内外套期保值业务保证金总额不超过人民币 10,000 万元（含 10,000 万元，但不包括交割当期头寸而支付的全额保证金在内）。

上述额度自公司董事会审议通过之日起 12 个月内有效，在审批期限内可循环使用，即任一时点的交易金额不超过上述额度。董事会授权董事长及相关人士在上述额度范围内具体签署套期保值业务相关协议及文件。

本次开展期货套期保值业务在董事会审批权限内，无需提交股东大会审议。

## 三、套期保值投资风险分析及风控措施

### （一）套期保值业务的风险分析

公司开展期货套期保值业务是为了锁定原材料价格波动的风险，不做投机和套利交易，但期货市场仍会存在一定风险：

1、价格波动风险：期货行情变动较大，可能产生价格波动风险，造成投资损失。

2、资金风险：期货交易采取保证金和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金风险。

3、流动性风险：可能因为成交不活跃，造成难以成交而带来流动性风险。

4、内部控制风险：期货交易专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内控体系不完善造成的风险。

5、技术风险：从交易到资金设置、风险控制，到与期货公司的联络，内部系统的稳定与期货交易的匹配等，存在着因程序错误、通信失效等可能导致交易无法成交的风险。

6、政策风险：期货市场法律法规等政策发生重大变化，可能引起市场波动或无法交易，从而带来风险。

## **（二）公司采取的风险控制措施**

1、公司将根据生产经营所需进行境外套期保值的操作，最大程度对冲价格波动风险。

2、公司将严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金，使用自有资金用于套期保值业务，不使用募集资金进行套期保值，同时加强资金管理的内部控制，不得超过批准的保证金额度。

3、公司将重点关注期货交易情况，合理选择合约月份，避免市场流动性风险。

4、公司制定了《期货套期保值业务管理制度》，对相关事项作出了明确的规定，公司将严格按照此制度规定对各个环节进行控制，同时加强相关人员的职业道德教育及业务培训，提高相关人员的综合素质。

5、公司将设立符合要求的计算机系统及相关设施，选配多条通道，降低技术风险。

6、在业务操作过程中，严格遵守有关法律法规的规定，防范法律风险，定期对套期保值业务的规范性、内控机制的有效性等方面进行监督检查。

## **四、开展套期保值业务对公司的影响**

开展期货套保，能一定程度上减少生产经营中原材料价格波动所带来的风险，降低价格波动对公司生产经营造成的影响，有利于公司生产经营的稳定性和可持续性，不会对公司正常生产经营产生重大影响。

公司将严格按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》及《企业会计准则第 24 号—套期会计》等相关规定及其指南，对拟开展的境外期货套期保值业务进行相应的核算处理和列报披露。

## **五、套期保值业务的持续披露**

1、如出现已交易套期保值业务的公允价值减值与用于风险对冲的资产价值变动加总，导致合计亏损或者浮动亏损金额达到公司最近一年经审计的归属于

上市公司股东净利润的 10%且绝对金额超过 1,000 万人民币的情况，公司将及时进行披露。

2、公司将根据监管部门的相关规定，在定期报告中详细披露报告期内套期保值业务以及相应的损益等情况。

## **六、独立董事意见**

1、公司在保证正常生产经营的前提下，使用自有资金开展期货套期保值业务履行了相关的审批程序，符合国家相关法律、法规及《公司章程》的有关规定，不存在损害公司及股东特别是中小股东利益的情形。

2、针对套期保值业务，公司制订了《期货套期保值业务管理制度》，确保按相关规定及流程操作，对各环节风险严格进行控制。

3、公司确定的套期保值交易品种、资金额度符合公司的实际生产经营情况，有利于降低原材料价格波动对公司正常经营的影响。

综上所述，我们认为公司本次开展期货套期保值业务合法、合规。因此，我们一致同意开展境内外期货套期保值业务。

## **七、备查文件**

- 1、第三届董事会第六次会议决议；
- 2、独立董事关于第三届董事会第六次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

芜湖富春染织股份有限公司董事会

2022 年 11 月 4 日