

浙江闰土股份有限公司

关于使用闲置自有资金开展金融衍生品交易的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确、完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担责任。

重要内容提示：

投资种类：远期结售汇金融衍生品、场外衍生品（包括但不限于场外期权和收益互换）或底层含场外衍生品的资管产品，挂钩标的资产包括证券、指数、商品、利率等，也可包括上述基础资产的组合

投资金额：自有资金不超过人民币 8 亿元

履行程序：公司拟使用自有资金开展金融衍生品交易的事项已经第六届董事会第十三次会议审议通过，尚需提交公司股东大会审议

特别风险提示：公司将风险控制放在首位，对金融衍生品交易业务严格把关，但金融市场受宏观经济的影响较大，该项投资可能受到政策风险、市场风险、信用风险、流动性风险、信息传递风险、不可抗力风险等因素影响，导致收益波动。敬请广大投资者注意投资风险。

一、开展金融衍生品交易的概述

1、投资目的

为提高资金使用效率和收益，在保证资金安全和正常生产经营的前提下，浙江闰土股份有限公司（以下简称“公司”）拟使用部分闲置自有资金开展外汇远期结售汇业务、金融衍生品或底层含场外衍生品的资管产品交易，取得一定投资收益，从而降低财务费用，同时提升公司整体业绩水平，保障公司股东的利益。

2、投资金额、资金来源及投资期限

公司及下属子公司拟使用不超过人民币 8 亿元的自有资金开展金融衍生品交易业务（其中使用不超过人民币 4 亿元的自有资金开展远期结售汇金融衍生品业务；使用不超过人民币 4 亿元的自有资金开展金融衍生品或底层含场外衍生品

的资管产品交易),在上述额度及期限内,资金可以循环滚动使用。使用期限自公司董事会和公司 2022 年度股东大会审议通过之日起 12 个月内有效,在上述额度及决议有效期内,资金可循环滚动使用。如单笔交易的存续期超过了决议有效期,则决议的有效期自动顺延至该笔交易终止之日止。

3、业务品种

拟交易场外衍生品(包括但不限于场外期权和收益互换)或底层含场外衍生品的资管产品,挂钩标的资产包括证券、指数、商品、利率等,也可包括上述基础资产的组合;远期结售汇金融衍生品。

4、交易对手方

公司仅向资信良好、具有合法资质的商业银行、证券公司、信托、银行理财子公司、基金公司或私募机构等机构从事金融衍生品交易业务(包括但不限于:购买其发行的场外衍生品或底层含场外衍生品的资管产品、远期结售汇金融衍生品),以规避可能产生的信用风险。

5、会计核算原则

公司根据《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——套期保值》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》等相关规定及其指南,对拟开展的金融衍生品交易业务进行相应的核算处理,反映资产负债表及损益表相关项目。

二、审议程序

根据《深圳证券交易所股票上市规则》《公司章程》《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》等相关规定,公司拟使用自有资金开展金融衍生品交易的事项已经第六届董事会第十三次会议审议通过,尚需提交公司股东大会审议。

三、风险分析及风控措施

(一) 风险提示

1、市场风险:受国内外宏观经济形势、汇率和利率波动、证券市场波动、标的行业周期、标的公司经营管理状况等多种因素的影响,标的市场价格会产生波动,公司的资金安全及收益存在一定的不确定性。

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、制度建设：公司已建立了《衍生品交易管理制度》及相关作业制度，对公司及下属子公司从事金融衍生品交易的操作原则、交易审批权限、操作程序、风险管理及信息披露作出了明确规定，能够有效规范金融衍生品交易行为，控制交易风险。

2、交易对手方管理：公司仅向资信良好、具有合法资质的商业银行、证券公司、信托、银行理财子公司、基金公司或私募机构等机构从事金融衍生品交易业务(包括但不限于：购买其发行的场外衍生品或底层含场外衍生品的资管产品、远期结售汇金融衍生品)，以规避可能产生的信用风险。

3、专人负责：由公司管理层代表、公司财务部门、证券部、投资部、审计部、法务部等相关部门成立专项工作小组，负责金融衍生品交易前的风险评估，分析交易的可行性及必要性，负责交易的具体操作办理，当市场发生重大变化时及时上报风险评估变化情况并提出可行的应急止损措施。

4、监督检查：独立董事、监事会有权对公司购买的衍生金融产品进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

5、定期披露：公司将严格按照深圳证券交易所的相关规定要求，及时完成信息披露工作。

四、开展金融衍生品交易的可行性和对公司的影响

1、公司坚持谨慎投资的原则，在确保公司正常经营的前提下，适度进行投资，不会影响公司主营业务的正常开展，同时，有利于公司提高资金使用效率和效益，为公司和股东创造更大的收益。

2、公司已制定《衍生品交易管理制度》，对金融衍生品交易业务的操作原则、审批权限、操作程序及后续管理作出了明确规定，能够有效规范金融衍生品交易

行为，控制交易风险。

3、公司及子公司在董事会决议有效期内和拟定额度内开展金融衍生品交易业务，不会影响公司的正常生产经营。

五、独立董事意见

公司在保证流动性和资金安全且不影响公司经营业务开展的前提下开展金融衍生品交易业务，有利于提高资金使用率，增加公司投资收益，进一步提升公司整体业绩水平，具有一定的必要性，不会对公司主营业务产生负面影响。公司已制定《衍生品交易管理制度》及相关的风险控制措施，有利于加强金融衍生品交易风险管理和控制。不存在损害公司及全体股东、特别是中小股东利益的情形。独立董事同意公司在本次董事会批准额度范围内开展金融衍生品交易业务，并将该事项提交公司股东大会审议。

六、监事会意见

监事会认为公司已制定了《衍生品交易管理制度》及相关的风险控制措施，有利于加强金融衍生品交易风险管理和控制，开展金融衍生品交易业务履行了相应的决策程序，不会影响公司的正常生产经营和项目建设。监事会同意公司在本次董事会批准额度范围内开展金融衍生品交易业务。

七、备查文件

- 1、公司第六届董事会第十三次会议决议；
 - 2、公司第六届监事会第十三次会议决议；
 - 3、独立董事关于使用闲置自有资金开展金融衍生品交易的独立意见。
- 特此公告。

浙江闰土股份有限公司

董事会

二〇二三年四月二十九日