

江苏丰山集团股份有限公司 关于 2018 年度开展金融衍生品交易业务的公告

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。

江苏丰山集团股份有限公司(以下简称“公司”)于 2018 年 10 月 23 日召开了第二届董事会第七次会议和第二届监事会第四次会议，审议通过了《关于开展金融衍生品交易业务的议案》。公司国际贸易结算货币主要为美元，因此人民币对美元汇率波动会对公司生产经营产生一定影响。为了规避美元收入的外汇汇率波动风险，有效降低主营业务收入的不确定性，根据《上海证券交易所股票上市规则》、《公司章程》等有关法律、法规和制度的规定并结合公司的具体情况，拟开展金融衍生品交易相关业务。该事项尚需提交 2018 年第二次临时股东大会审议。具体内容如下：

一、开展业务种类

1、开展远期结售汇业务

远期结售汇业务是通过外汇指定银行与客户协商签订远期结售汇协议，约定未来办理结汇或售汇的外汇币种、金额、汇率和期限，到期即按照该协议的约定办理结售汇业务。由于远期结售汇把汇率的时间结构从将来转移到当前，事先约定了将来某一日向银行办理结汇或售汇业务的汇率，所以这种方法能够消除外汇风险。

2、人民币外汇期权组合业务

人民币对外汇期权组合业务是公司针对未来的实际结汇需求，买入一个执行价格较低（以一单位外汇折合人民币计量执行价格）的外汇看跌期权，同时卖出一个执行价格较高的外汇看涨期权，按照公司未来实际结汇需求可将未来某个时间（一年以内）汇率锁定在一定的区间之内，达到降低远期结汇风险的目的。

二、货币种类和业务规模

1、交易币种。只限于公司生产经营所使用的主要结算货币，开展交割期与预测回款期一致，且金额与预测回款金额相匹配的远期结售汇业务和人民币对外汇期权组合业务。

2、资金投入。根据公司实际业务需要，上述外汇业务的交易金额不超过 5000 万美元，投入资金为公司自有资金。

3、有效期：自本议案通过公司股东大会之日起至 2018 年年度股东审议相关议案之日止。

三、对公司的影响及潜在风险

远期结售汇等业务，可以在一定程度上规避汇率波动对公司的影响，使公司专注于生产经营，在汇率发生大幅波动时，公司仍保持一个稳定的利润水平。同时，远期结售汇等业务操作也会存在汇率波动风险，在汇率行情变动较大的情况下，远期结售汇等业务的汇率报价可能低于即期市场汇率，造成汇兑损失。

人民币对外汇期权组合业务实质上是一种人民币外汇交割权利的交易。期权到期日，如果公司和银行均选择放弃行权，公司只能按照到期当日的即期汇率做结售汇业务，从而损失期初支付的期权费；如果银行选择行权，公司须按照银行买入期权的执行价格与银行进行交割，造成一定的损失。

四、公司采取的风险控制措施

1、为防止远期结售汇延期交割，公司加强应收账款的管理，积极催收应收账款，避免出现应收账款逾期的现象。

2、公司建立了相关内控管理制度，对交易审批权限、内部审核流程、决策程序、信息隔离措施、内部风险报告制度及风险处理程序、信息披露等做出明确规定。

3、鉴于公司开展以上业务的目的，目前所选取的均为低风险金融产品，公司上述业务只允许与具有合法经营资格的股份制商业银行进行交易。

4、仅以外贸业务开展中锁定业务风险敞口为目标，不从事任何形式或实质上的投资业务。

5、公司内部审计部门将会定期、不定期对实际交易合约签署及执行情况进行核查。

五、独立董事意见

独立董事意见如下：公司的衍生品交易业务指公司从事的远期结售汇业务和人民币外汇期权组合业务。根据《上海证券交易所股票上市规则》、《公司章程》等有关法律、法规和制度的规定并结合公司的具体情况，公司 2018 年度金融衍生品交易业务的总金额不超过 5000 万美元，符合有关制度和法规的要求，符合公司生产经营的实际需要，有利于公司的长远发展，符合公司股东的利益。独立董事同意上述议案，并同意该议案提交公司股东大会审议。

特此公告。

江苏丰山集团股份有限公司董事会

2018 年 10 月 24 日