

上海万业企业股份有限公司 关于开展金融衍生品业务的公告

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。

上海万业企业股份有限公司（以下简称“公司”）为提高公司资金使用效率，在不影响正常经营的情况下，合理利用部分自有资金投资金融衍生品，为公司增加资金收益，为公司及股东获取更多的回报。截至本公告披露日，公司金融衍生品业务累计投资收益达公司最近一期经审计净利润的 10%以上，现将金融衍生品业务相关具体情况披露如下：

一、金融衍生品投资的基本情况

序号	发行方	编号	成立日期	本金(亿元)	实际收益(元)
1	申万宏源证券有限公司	SWHY-WYQY-20002	2020/9/16	1	10,608,219.18
2	申万宏源证券有限公司	SWHY-WYQY-21001	2021/1/20	1	8,087,671.23
3	中信证券股份有限公司	106773_E_20200811_01_PNPAUTOSB	2020/8/11	0.8	18,723,287.67
4	申万宏源证券有限公司	SWHY-WYQY-20001	2020/8/11	0.2	4,694,794.52
合计				3	42,113,972.60

注：上表中系最近 12 个月内已敲出的金融衍生品投资情况。

二、金融衍生品投资的具体情况

（一）金融衍生品交易确认书主要条款

1、申万宏源证券有限公司金融衍生品交易确认书

编号：SWHY-WYQY-20002

名义本金额：100,000,000.00 元

标的：中证 500 指数（代码：000905.SH）

交易期限：729 天

年度计息基数：365 天

起始日：2020 年 9 月 16 日，如该日为非交易日，则起始日应自动推迟至该日后的第一个交易日

到期日：T22=2022 年 9 月 15 日，如该日为非交易日，则到期日应自动推迟至该日后的第一个交易日

敲出观察日（Tn'）：根据协议条款，共设置 22 个日期

提前到期日（Tn）：根据协议条款，共设置 21 个日期

敲出事件：在任一敲出观察日 Tn'（n=1 至 22），若标的证券的收盘价（点，按照四舍五入法精确到小数点后 2 位）大于或等于敲出价格，则视为敲出事件发生；若期权在敲出观察日 Tn'（n=1 至 21）发生敲出事件，则本交易确认书项下交易在对应的提前到期日 Tn 自动终止；若期权在敲出观察日 T22'发生敲出事件，则本交易确认书项下交易在对应的到期日 T22 终止

敲出收益率：32%

红利票息：32%

2、申万宏源证券有限公司金融衍生品交易确认书

编号：SWHY-WYQY-21001

名义本金额：100,000,000.00 元

标的：中证 500 指数（代码：000905.SH）

交易期限：731 天

年度计息基数：365 天

起始日：2021 年 1 月 20 日，如该日为非交易日，则起始日应自动推迟至该日后的第一个交易日

到期日：T22=2023 年 1 月 20 日，如该日为非交易日，则到期日应自动推迟至该日后的第一个交易日

敲出观察日（Tn'）：根据协议条款，共设置 22 个日期

提前到期日 (Tn): 根据协议条款, 共设置 21 个日期

敲出事件: 在任一敲出观察日 Tn' (n=1 至 21), 若标的证券的收盘价 (点, 按照四舍五入法精确到小数点后 2 位) 大于或等于敲出价格, 则视为敲出事件发生; 若期权在敲出观察日 Tn' (n=1 至 21) 发生敲出事件, 则本交易确认书项下交易在对应的提前到期日 Tn 自动终止; 若期权在敲出观察日 T22' 发生敲出事件, 则本交易确认书项下交易在对应的到期日 T22 终止

敲出收益率: 24.60%

红利票息: 24.60%

3、中信证券股份有限公司场外衍生品交易确认书

编号: 106773_E_20200811_01_PNPAUTOSB

交易约定日: 2020 年 8 月 11 日

合约到期日: 2022 年 8 月 11 日

期初观察日: 2020 年 8 月 11 日

期末观察日: 2022 年 8 月 11 日

敲出事件规则: 在任一存续期观察日, 若所有标的证券收盘价格均大于或等于其对应的敲出价格, 则触发敲出事件, 交易在该存续期观察日对应的合约终止日自动提前终止。

存续期观察日: 根据协议条款, 共设置 19 个日期

期权类型: 自动赎回期权

合约名义本金额: 80,000,000.00 元

补偿收益率: 25.50%

4、申万宏源证券有限公司金融衍生品交易确认书

编号: SWHY-WYQY-20001

名义本金额: 20,000,000.00 元

标的: 中证 500 指数 (代码: 000905.SH)

交易期限：731 天

年度计息基数：365 天

起始日：2020 年 8 月 11 日，如该日为非交易日，则起始日应自动推迟至该日后的第一个交易日

到期日：T22=2022 年 8 月 15 日，如该日为非交易日，则到期日应自动推迟至该日后的第一个交易日

敲出观察日（Tn'）：根据协议条款，共设置 22 个日期

提前到期日（Tn）：根据协议条款，共设置 21 个日期

敲出事件：在任一敲出观察日 Tn'（n=1 至 22），若标的证券的收盘价（点，按照四舍五入法精确到小数点后 2 位）大于或等于敲出价格，则视为敲出事件发生；若期权在敲出观察日 Tn'（n=1 至 21）发生敲出事件，则本交易确认书项下交易在对应的提前到期日 Tn 自动终止；若期权在敲出观察日 T22'发生敲出事件，则本交易确认书项下交易在对应的到期日 T22 终止

敲出收益率：25.50%

红利票息：25.50%

三、对公司的影响

公司开展金融衍生品业务不会对公司未来主营业务、财务状况、经营成果和现金流量造成较大影响。公司投资金融衍生品业务所使用的资金为闲置自有资金，不影响公司的日常运营资金需求和主营业务的正常开展。通过开展金融衍生品业务，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，为公司股东谋取更多的投资回报，符合公司和全体股东的利益。

四、风险提示

公司使用部分自有资金开展金融衍生品业务，但金融市场受宏观经济、财政及货币政策的影响较大，不排除该项投资可能受到市场波

动的影响，公司将最大限度控制投资风险，敬请广大投资者注意投资风险。

五、截至本公告日，公司最近十二个月累计开展金融衍生品业务的情况

序号	产品编号	实际投入金额（万元）	实际敲出收回的本金（万元）	实际收益（元）	尚未敲出本金金额（万元）
1	申万宏源 SWHY-WYQY-20002	10,000	10,000	10,608,219.18	0
2	申万宏源 SWHY-WYQY-21001	10,000	10,000	8,087,671.23	0
3	中信证券 106773_E_20200811_01_PNPAUTOSB	8,000	8,000	18,723,287.67	0
4	申万宏源 SWHY-WYQY-20001	2,000	2,000	4,694,794.52	0
5	申万宏源 SWHY-WYQY-21002	5,000	0	0	5,000
6	中信证券 106773_E_20210120_01_PNPAUTOSB	15,000	0	0	15,000
7	中信证券 106773_E_20210125_01_PNPAUTOSB	15,000	0	0	15,000
合计		65,000	30,000	42,113,972.60	35,000

特此公告。

上海万业企业股份有限公司董事会

2021年7月21日