

百大集团股份有限公司 关于授权管理层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。

重要内容提示：

- 投资种类：场外衍生品（包括但不限于场外期权和收益互换）、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：不超过人民币 1 亿元的闲置自有资金，额度内资金可循环滚动使用。投资期限内任一时点的交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过投资额度。
- 履行的审议程序：已经公司第十届董事会第二十二次会议审议通过，无需提交股东大会审议。
- 特别风险提示：投资过程中存在市场风险、流动性风险、履约风险、法律风险等，敬请投资者注意投资风险。

一、投资情况概述

1、投资目的

本次投资不以投机为目的，仅为提升公司自有资金使用效率及资金收益水平，增强公司盈利能力。

2、投资额度

公司（含子公司）拟使用不超过人民币 1 亿元开展本业务，额度内资金可循环滚动使用。投资期限内任一时点的交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不超过投资额度。

3、投资范围

拟交易场外衍生品（包括但不限于场外期权和收益互换）、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。

4、资金来源

公司开展金融衍生品交易业务的资金为闲置自有资金。

5、投资期限

自董事会决议通过之日起 12 个月内有效。

二、履行的审议程序

公司已于 2022 年 9 月 19 日召开第十届董事会第二十二次会议，全体董事一致审议通过了《关于授权管理层开展金融衍生品交易业务的议案》，同意公司（含子公司）在不超过人民币 1 亿元的额度内开展金融衍生品交易业务，额度内资金可循环滚动使用。投资期限自董事会决议通过之日起 12 个月内有效，期限内任一时点的交易金额（含前述投资的收益进行再投资的相关金额）不应超过衍生品投资额度。董事会同时授权公司董事长在投资额度范围内签署相关合同。由总经理作为具体投资项目的运作和处置的直接责任人，具体负责投资标的分析、筛选；买卖决策、实施，并指定公司投资部门适当人员负责执行具体操作事宜。

本次拟开展的金融衍生品交易不涉及关联交易，在董事会权限范围内，无需提交股东大会审议。

三、金融衍生品交易风险分析及风控措施

1、可能存在的风险

（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，投资收益存在一定的不确定性。

（2）流动性风险：因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

（3）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。

（4）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。

2、风险控制措施

（1）制度建设：公司已制定《证券及金融衍生品投资管理制度》，对公司及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做出了明确规定，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：公司将慎重选择信用良好、规模较大，并能提供专业金融服

务的机构为交易对象。公司仅与资信良好、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进行交易，购买其发行的场外衍生品、底层含场外衍生品的资管产品，以规避可能产生的信用风险。

(3) 专人负责：公司总经理、投资部成立专项工作小组，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，针对每个项目设置对应的止损方案，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、监事会有权对资金使用情况进行了监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

四、开展金融衍生品交易对公司的影响

在充分保障公司日常经营性资金需求、不影响公司正常生产经营并有效控制风险的前提下使用自有资金开展金融衍生品交易业务，有利于提升公司自有资金使用效率及资金收益水平，增强公司盈利能力，符合公司和全体股东的利益。

五、独立董事意见

公司独立董事对该事项发表独立意见如下：

经审阅该项议案，我们认为在充分保障公司日常经营性资金需求、不影响公司正常生产经营并有效控制风险的前提下使用自有资金开展金融衍生品交易业务，有利于提升公司资金使用效率及资金收益水平，增强公司盈利能力，符合公司和全体股东的利益。该事项已经公司第十届董事会第二十二次董事会审议通过，审议程序符合《公司法》、《证券法》等法律法规及《公司章程》等公司内部规章制度的规定，不存在损害公司及其他股东特别是中小股东的利益的情况。

六、备查文件目录

- 1、百大集团股份有限公司第十届董事会第二十二次会议决议。
- 2、百大集团股份有限公司独立董事关于第十届董事会第二十二次会议相关事项的独立意见。

特此公告。

百大集团股份有限公司董事会
二〇二二年九月二十一日