

证券代码：600737

证券简称：中粮糖业

公告编号：2019-023 号

中粮屯河糖业股份有限公司 关于开展金融衍生品交易相关业务的公告

特别提示

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。

中粮屯河糖业股份有限公司（以下简称“中粮糖业”或“公司”）第八届董事会第三十八次会议审议通过了《关于公司开展金融衍生品交易相关业务的议案》，具体内容如下：

一、概述

公司及控股子公司在日常经营过程中涉及大量外币业务，包括贸易项下外汇资金收付、外币融资风险敞口等，主要以美元、欧元、英镑等为主，当汇率出现较大波动时，汇兑损益对公司的经营业绩会产生一定影响。为减少因外汇结算、汇率、利率波动等形成的风险，公司及控股子公司拟分多批开展最高额度不超过4亿美元（其他币种按当期汇率折算成美元汇总）的金融衍生品交易业务，利用金融衍生品进行汇率及利率风险管理，以降低和防范汇率及利率波动对公司经营业绩的影响。在不超过上述授权额度内，提请股东大会授权公司董事长审批金融衍生品投资的相关事宜，授权公司财务部办理具体手续，授权期限自股东大会审议通过之日起一年内有效。

二、开展业务种类

远期结售汇业务

三、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。

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 4 亿美元，投入资金为公司自有资金。

3、有效期：自本议案通过股东大会审议之后 12 个月内。

四、对公司的影响及潜在风险

远期结售汇业务，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。

公司及控股子公司开展的外汇远期结售汇业务遵循锁定汇率风险原则，不做投机性、套利性的交易操作。但远期结售汇操作仍存在一定的风险：

1、汇率波动风险：在汇率行情变动较大的情况下，银行远期结售汇汇率报价可能偏离公司实际收付时的汇率，造成公司汇兑损失。

2、销售回款预测风险：业务部门根据客户订单和预计订单进行回款预测，实际执行过程中，由于全球宏观经济形式以及客户经营状况变化可能会出现客户调整订单和预测，造成公司销售波动及回款预测不准，导致远期结汇延期交割风险。

五、公司采取的风险控制措施

公司及控股子公司开展远期外汇交易遵循套期保值原则，不做投机性套利交易，主要的风险控制措施如下：

1、在签订远期结售汇业务合约时严格按照公司预测的收汇、付汇期和金额进行交易，所有远期结售汇业务均有真实的贸易背景；

2、为防止远期结售汇延期交割，公司高度重视应收账款的管理，及时掌握客户支付能力信息，加大跟踪催收应收账款力度，尽量将该风险控制在最小的范围内。同时公司为出口货款购买信用保险，从而降低客户拖欠、违约风险；

3、公司制定了《资金业务相关保值产品管理制度》、《衍生品交易渠道管理

办法》，对公司金融衍生品投资的风险控制、操作流程等做出明确规定。

4、公司严格控制金融衍生品投资的种类及规模，不做超出经营实际需要的复杂金融衍生品投资，不做金融衍生品投机业务。

六、独立董事意见

独立董事认为：公司根据有关法律法规制定了金融衍生品投资的内控管理制度。鉴于公司及控股子公司在日常经营过程中涉及大量外币业务，使用自有资金开展金融衍生品投资业务有利于规避和防范汇率风险，降低汇率波动对公司经营业绩的影响。我们认为公司开展的金融衍生品投资业务与日常经营管理紧密相关，符合有关法律、法规的有关规定，审议程序合法合规，不存在损害公司股东利益的情形。

特此公告。

中粮屯河糖业股份有限公司董事会

二〇一九年八月六日