

股票代码：002032

股票简称：苏泊尔

公告编号：2021-020

## 浙江苏泊尔股份有限公司

### 关于开展外汇衍生品交易业务的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

浙江苏泊尔股份有限公司（以下简称“公司”、“本公司”或“苏泊尔”）第七届董事会第五次会议审议通过《关于开展外汇衍生品交易业务的议案》，公司及公司控股子公司拟使用自有资金总额度不超过5,000万美元或等额其他货币开展外汇衍生品交易业务。具体内容如下：

#### 一、外汇衍生品交易业务概述

为减少汇率波动带来的风险，加强对外币资产头寸的监控和管理，公司拟开展总额度不超过5,000万美元或等额其他货币的外汇衍生品交易业务（以下简称“本次业务”）。

#### 二、外汇衍生品交易业务的基本情况

##### 1、外汇衍生品交易对手方

公司拟开展的外汇衍生品交易业务的交易对手方均为经营稳健、资信良好、与公司合作关系稳定、具有外汇衍生品交易业务经营资格的具有国际A-或同等信用等级以上的大型商业银行。

##### 2、外汇衍生品交易业务品种

目前公司面临的主要是美元汇率波动风险，结合实际业务需要，公司拟开展以套期保值为目的的外汇衍生品交易业务，包括远期和互换等产品，不使用期权工具。单次外汇衍生品交易业务的期限一般不超过6个月。

##### 3、拟投入金额及业务期限

公司拟开展最高余额不超过5,000万美元或等额其他货币的外汇衍生品交易业务，在额度范围内资金可在一年期限内滚动使用。公司将利用自有资金开展外汇衍生品交易业务。

#### 三、外汇衍生品交易业务的风险及应对措施

##### （一）开展外汇衍生品交易的风险

1、价格波动风险：可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动而造成外汇衍生品价格变动而造成亏损的市场风险。

2、内部控制风险：外汇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：开展外汇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的风险。

## （二）风险应对措施

1、明确外汇衍生品交易原则：外汇衍生品交易以保值为原则，最大程度规避汇率波动带来的风险，并结合市场情况，适时调整操作策略，提高保值效果。

2、制度建设：公司已建立《外汇衍生品交易管理办法》，对衍生品交易的授权范围、审批程序、操作要点、风险管理及信息披露做出了明确规定，能够有效规范外汇衍生品交易行为，控制外汇衍生品交易风险。

3、产品选择：在进行外汇衍生品交易前，在多个交易对手与多种产品之间进行比较分析，选择最适合公司业务背景、流动性强、风险可控的外汇衍生工具开展业务。公司以远期为工具进行一般套期，以互换合约进行滚动套期。

4、交易对手管理：慎重选择从事外汇衍生品业务的交易对手。公司仅与具有合法资质的大型商业银行等外汇机构开展外汇衍生品交易业务，规避可能产生的法律风险。

5、专人负责：由公司管理层代表、资金部、财务共享中心、审计部、证券部等相关部门成立专项工作小组，负责外汇衍生品交易风险评估、交易操作、交易记录和监督。当市场发生重大变化时，工作小组决策实施应急止损措施。

## 四、外汇衍生品交易业务的可行性分析

公司操作的衍生品业务以及所涉及的币种，均匹配公司业务，充分利用外汇衍生交易的套期保值功能，对冲经营活动中的汇率风险，降低汇率波动对公司的影响。此外，公司已建立完善的《外汇衍生品交易管理办法》并明确风险应对措施，业务风险可控，不存在损害公司和股东利益的行为。

## 五、外汇衍生品交易业务对公司生产经营的影响

### 1、外汇衍生品交易业务对公司生产经营的影响

公司经营中，外币收付汇、外币存款、以外币计价的资产负债金额较大，随着外汇市场波动日益增加，汇率波动对公司经营成果的影响也逐渐加大。公司拟开展外汇衍生品交易业务，从而规避汇率波动带来的风险。拟开展外汇衍生品交易业务，从而规避汇率波动带来的风险。

### 2、外汇衍生品交易业务对公司财务的影响

公司外汇衍生品交易业务的相关会计政策及核算原则将严格按照中华人民共和国财政部发布的《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》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》等相关规定执行。开展套期保值所使用的外汇衍生品的公允价值变动，将计入公司的当期损益，从而将增加或减少公司利润水平。

特此公告。

浙江苏泊尔股份有限公司董事会

二〇二一年四月一日