

证券代码：605138

证券简称：盛泰集团

公告编号：2024-065

转债代码：111009

转债简称：盛泰转债

盛泰智造集团股份有限公司

关于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法律责任。

重要内容提示：

● 交易目的：为有效规避和应对汇率波动等对公司带来的风险，减少对经营的影响，增强财务稳健性。

● 交易种类：公司及子公司拟开展的金融衍生品交易业务为期货、期权、远期、互换等产品或上述产品的组合，对应基础资产包括利率、汇率、货币、商品或上述资产的组合。

● 交易金额及期限：公司及子公司拟在任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币2亿元（或等值外币）的额度范围内开展金融衍生品交易业务，额度使用期限自该事项经公司董事会审议通过之日起12个月内有效。在上述额度及期限内资金可循环滚动使用。

● 审议程序：公司于2024年8月23日召开第三届董事会第二次会议，审议通过了《关于公司及子公司开展金融衍生品交易业务的议案》，本次议案无需提交股东大会。

● 特别提示：公司及子公司进行金融衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不进行单纯以盈利为目的的金融衍生品交易，所有金融衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，但金融衍生品业务操作仍存在一定的风险，敬请广大投资者注意投资风险。

一、交易情况概述

（一）交易目的

盛泰智造集团股份有限公司（以下简称“公司”）主要从事纺织面料及成衣

的生产与销售，是一家具备核心生产技术的主要服务于国内外知名品牌的纺织服装行业跨国公司。为有效规避和应对汇率波动等对公司带来的风险，减少对经营的影响，增强财务稳健性，公司及合并报表范围内子公司拟根据具体业务情况适度开展金融衍生品交易业务，提高公司及子公司应对外汇波动风险的能力，降低汇率波动对公司经营业绩的不利影响

（二）拟开展金融衍生品交易业务品种

公司及子公司拟开展交易的金融衍生品交易业务为期货、期权、远期、互换等产品或上述产品的组合，对应基础资产包括利率、汇率、货币、商品或上述资产的组合。

（三）拟开展金融衍生品交易业务对手方

公司及子公司拟开展金融衍生品交易业务的交易对手方为经营稳健、资信良好，具有金融衍生品交易业务经营资格的银行等金融机构，与公司不存在关联关系。

（四）拟开展金融衍生品交易业务额度、期限及授权

公司及子公司拟在任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 2 亿元（或等值外币）的额度范围内开展金融衍生品交易业务，额度使用期限自该事项经公司董事会审议通过之日起 12 个月内有效。在上述额度及期限内资金可循环滚动使用，期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过已审议额度。

（五）资金来源

公司及子公司开展金融衍生品交易业务投入的资金来源为自有资金，不涉及募集资金。

二、审议程序

公司于 2024 年 8 月 23 日召开第三届董事会第二次会议，审议通过了《关于公司及子公司开展金融衍生品交易业务的议案》，同意公司及子公司在任一交易日持有的最高合约价值不超过人民币 2 亿元（或等值外币）的额度范围内开展金融衍生品交易业务，具体包括期货、期权、远期等业务。该议案无需提交股东大会审议。为了提高工作效率，保证后续工作的顺利开展，提请授权公司管理层在董事会审议额度范围内行使金融衍生品交易业务的审批权限并签署相关文件，在

上述额度范围内资金可滚动使用，由公司财务部门负责具体实施相关事宜。授权期限自董事会审议通过之日起 12 个月内有效。

三、开展金融衍生品交易业务的投资风险分析及风险控制措施

（一）投资风险分析

公司开展金融衍生品交易业务时，遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不进行单纯以盈利为目的的金融衍生品交易。但金融衍生品业务操作仍存在一定的风险：

1、市场风险：金融衍生品业务合约汇率、利率与到期日实际汇率、利率的差异将产生业务损益；在金融衍生品的存续期内，存在因标的利率、汇率等市场价格波动导致金融衍生品价格变动，从而产生公允价值变动损益，至到期日公允价值变动损益的累计值等于交易损益。

2、信用风险：公司进行的衍生品交易对手均为信用良好且与公司已建立长期业务往来的银行，履约风险较低。

3、其它风险：在开展业务时，如操作人员未按规定程序进行金融衍生品业务操作或未充分理解衍生品信息，将带来操作风险；如交易合同条款不明确，将可能面临法律风险。

（二）风险控制措施

1、公司制定了《盛泰智造集团股份有限公司金融衍生品交易管理制度》，明确了金融衍生品交易的职责分工，公司开展金融衍生品交易的风险控制、审批程序、后续管理和信息披露等进行了明确规定，通过加强业务流程、决策流程和交易流程的风险控制，有效规范金融衍生品交易行为，有效降低金融衍生品交易风险和操作风险。

2、公司财务部应充分理解衍生品交易的特点和潜在风险，在金融衍生品业务操作过程中，持续跟踪衍生品公开市场价格或公允价值的变化，及时评估金融衍生品交易业务的风险敞口变化情况，发现异常情况及时上报，并执行应急措施。

3、公司内审部应每季度或不定期地对金融衍生品交易的实际操作情况、资金使用情况和盈亏情况进行核查，稽核交易是否根据相关内部制度执行，并将核查结果向公司董事会汇报。

4、公司的金融衍生品交易将选择结构简单、风险可控的金融衍生产品开展套期保值业务，严格控制金融衍生品交易业务的交易规模。

5、公司将慎重选择从事金融衍生品业务的交易对手，并审慎审查合约条款，以防范产生的法律风险。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司及子公司进行金融衍生品交易业务遵循合法、谨慎、安全和有效的原则，不进行单纯以盈利为目的的金融衍生品交易，所有金融衍生品交易业务均以正常生产经营为基础，有效规避和应对汇率波动等对公司带来的风险，减少对经营的影响，增强财务稳健性，交易业务风险可控，不存在损害公司和股东利益的行为。

公司根据财政部《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——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》相关规定及其指南，对拟开展的金融衍生品交易业务进行相应的核算处理，反映资产负债表及损益表相关项目，具体结果以审计机构出具审计报告为准。

特此公告。

盛泰智造集团股份有限公司董事会

2024 年 8 月 27 日