

证券代码：601869
债券代码：175070

证券简称：长飞光纤
债券简称：20长飞01

公告编号：临 2023-011

长飞光纤光缆股份有限公司

关于公司及下属公司 2023 年度开展外汇期货及衍生品套期保值交易业务的公告

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：

- 长飞光纤光缆股份有限公司（以下简称“公司”、“本公司”）及下属公司拟开展外汇期货及衍生品套期保值交易业务的产品类型包括即期交易、远期交易，外汇掉期、利率掉期及期权等相关组合产品。
- 公司及下属公司拟开展的外汇期货及衍生品套期保值交易业务额度为6亿美元或其他等值外币，额度使用期限自董事会审议批准之日起12个月。
- 风险提示：本套期保值交易业务无本金或收益保证，在交易过程中存在市场风险、流动性风险、履约风险等相关风险，敬请广大投资者注意投资风险。

一、 交易业务情况概述

1、 交易目的

随着公司国际化战略的深入实施，海外业务的持续拓展，公司 2022 年度海外业务收入已达约人民币 46.4 亿元，占公司总收入的比例达到 33.6%。公司及下属公司基于外汇资产、负债状况及外汇收支业务具体情况，开展与日常经营需求紧密相关的外汇期货及衍生品套期保值交易业务，有利于控制公司外汇系统性风险、降低外汇市场波动对公司经营业绩的影响，有利于保障公司资产安全及海外业务长期可持续发展。

2、 交易金额及期限

公司及下属公司拟开展的外汇期货及衍生品套期保值交易业务额度为6亿美元或其他等值外币，额度使用期限自公司第三届董事会第二十四次会议审议批准

之日起 12 个月。上述额度在期限内可循环滚动使用，但期限内任一时点的投资余额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过 6 亿美元或其他等值外币。

3、交易方式及类型

公司及下属公司拟开展的外汇期货及衍生品套期保值交易业务只限于与生产经营所使用的主要结算货币相同的币种，交易对手方为具有期货及衍生品交易业务经营资格、经营稳健且资信良好的国内和国际性金融机构。进行的外汇期货及衍生品交易业务品种具体包括即期交易、远期交易，外汇掉期、利率掉期及期权等相关组合产品。

4、交易资金来源

公司及下属公司拟开展的外汇期货及衍生品套期保值交易业务资金来源为公司自有资金，不涉及使用募集资金。

二、公司履行的决策程序

公司于 2023 年 3 月 31 日召开第三届董事会第二十四次会议，以同意 12 票、反对 0 票、弃权 0 票审议通过了《关于公司及下属公司 2023 年度开展外汇期货及衍生品套期保值交易业务的议案》，同意公司开展额度为 6 亿美元或其他等值外币的外汇期货及衍生品套期保值交易业务，并授权管理层具体实施。独立董事本议案发表了同意的独立意见。本议案无需提交公司股东大会审议批准。

三、交易业务风险分析及风控措施

（一）交易业务风险

1、市场风险

外汇期货及衍生品合约汇率、利率与相应市场实际汇率、利率的差异将引起合约价值变动。该等变动与合约对应的风险资产的价值变动形成一定的对冲，但仍有亏损的市场风险。

2、流动性风险

公司及下属公司拟开展的外汇期货及衍生品套期保值交易业务基于公司外汇资产、负债状况及外汇收支业务具体情况开展，与实际外汇收支相匹配。但仍存在因市场流动性不足而无法完成交易的风险。

3、履约风险

若外汇期货及衍生品合约交易对手方无法完成交易，则存在履约风险。

4、其他风险

因相关法律法规发生变化或交易合约条款不明确，可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

（二）风控措施

1、公司及下属公司拟开展的外汇期货及衍生品套期保值交易业务与日常经营需求紧密相关，不存在任何风险投机行为。

2、公司已制定《外汇风险管理制度》《外汇交易办法》规范公司及下属公司外汇期货及衍生品交易业务，并针对新兴市场货币外汇风险制定《小币种外汇风险控制管理办法》以强化风险管理。

3、公司选择的交易对手方为具有期货及衍生品交易业务经营资格、经营稳健且资信良好的国内和国际性金融机构，并将审慎核查与该等交易对手方签订的合约条款，严格执行风险管理制度。

四、交易业务对公司的影响

公司及下属公司开展与日常经营需求紧密相关的外汇期货及衍生品套期保值交易业务，有利于控制公司外汇系统性风险、降低外汇市场波动对公司经营业绩的影响，有利于保障公司资产安全及海外业务长期可持续发展。

公司根据《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》《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》等相关规定及其指南，对外汇衍生品交易业务进行相应的会计核算，并根据《上海证券交易所股票上市规则》《上海证券交易所上市公司自律监管指引第 5 号——交易与关联交易》等对套期保值业务的相关信息履行披露义务。

五、独立董事意见

公司及下属公司拟开展的外汇期货及衍生品套期保值交易业务围绕公司海外业务日常经营所需，基于外汇资产、负债状况及外汇收支业务具体情况开展，以控制公司外汇系统性风险、降低外汇市场波动对公司经营业绩的影响为目的，不存在任何风险投机行为。同意公司《关于开展外汇期货及衍生品套期保值交易业务的可行性分析报告》。公司针对该等业务制定了相应的管理制度，有利于加强交易风险管理的控制，不存在损害公司和股东，尤其是中小投资者利益的情形。我们同意公司及下属公司拟开展的外汇期货及衍生品套期保值交易业务。

特此公告。

备查文件：

- 1、长飞光纤光缆股份有限公司第三届董事会第二十四次会议决议
- 2、独立董事关于第三届董事会第二十四次会议相关事项的独立意见
- 3、关于开展外汇期货及衍生品交易业务的可行性分析报告

长飞光纤光缆股份有限公司董事会

二〇二三年三月三十一日