齐峰新材料股份有限公司
2022 年度金融衍生品交易计划书
齐峰新材料股份有限公司（以下简称“公司”）及公司全资或控
股子公司为实现稳健经营，规避外汇市场的风险、降低外汇结算成本，
拟开展以套期保值为目的的金融衍生品投资业务（包括但不限于远期、
掉期、期权合约等或上述产品的组合）。根据深圳证券交易所《深圳
证券交易所股票上市规则》及相关法律、法规的规定，本议案需提交
公司股东大会审议通过后方可实施。
一、衍生品投资的基本情况
公司及公司全资或控股子公司拟通过开展金融衍生品业务来减
小、规避因外汇结算、汇率波动等形成的风险，操作的金融衍生品业
务主要包括：远期结汇、远期售汇、货币期权等产品。
1、2022 年公司衍生品投资业务预计金额
基于国内外货币市场的特点，结合公司已有的产品外销及原料采
购等业务，且业务量较大的特点，公司及公司全资或控股子公司 2022
年度拟开展衍生品交易合约量不超过 5 千万美元（包括但不限于国际、
国内产生的金融衍生品交易、远期、掉期合约等）。如超过 5 千万美
元，则须依据《金融衍生品交易管理制度》，上报公司董事会、股东
大会审批同意后方可进行操作。
2、金融衍生品业务期间、对象：本次 2022 年度至 2022 年度股
东大会通过金融衍生品交易计划书期间，交易对象为相关金融机构。
二、衍生品投资的必要性
公司及控股子公司在日常经营过程中会涉及大量的外币业务(包
括贸易项下外汇资金收付、外币融资风险敞口、海外外币净资产风险
敞口等)。当汇率出现较大波动时，汇兑损益会对公司造成一定影响。
为了规避外汇市场的风险、降低外汇结算成本，防范汇率波动对公司
生产经营、成本控制造成的不良影响，公司拟利用衍生金融品管理汇
率及利率风险，达到套期保值的目的。
三、公司投资衍生品的准备情况
1、公司制定了《金融衍生品交易管理制度》，对公司进行衍生品

投资的风险控制、审议程序、后续管理等进行明确规定，有效规范衍
生品投资行为，控制衍生品投资风险。
2、公司在从事金融衍生品交易业务时由公司财务部门在多个市
场与多种产品之间进行比较、询价；必要时可聘请专业机构对待选的
衍生品进行分析比较。财务部负责评估衍生品的交易风险，分析衍生
品交易的可行性与必要性，提出开展衍生品交易的建议计划书。
3、公司财务部已充分理解衍生品投资的特点和潜在风险，严格
执行衍生品投资的业务操作和风险管理制度。
四、衍生品投资的风险分析
1、市场风险：当国际、国内经济形势发生变化时，相应的汇率、
利率将可能对公司金融衍生品交易产生不利影响，公司将及时根据市
场变化调整策略。
2、流动性风险：因开展的衍生品业务均为通过金融机构操作的
场外交易，存在平仓斩仓损失而须向银行支付费用的风险；公司拟开
展的金融衍生品业务性质简单，交易的期限均根据公司未来的收付款
预算进行操作，基本在一年以内，对公司流动性没有影响。
3、信用风险：本方案交易区间控制在 12 个月之内，分批、分阶
段实施，交易对方均为境内金融机构，因此违约风险很低。即便出现
非常特殊的情况不能按期交割，也可通过掉期交易加以展期，使公司
有能力严格控制违约风险的发生。
4、操作风险：公司在开展衍生品交易业务时，如发生操作人员
未按规定程序报备及审批，或未准确、及时、完整地记录金融衍生品
业务信息，将可能导致衍生品业务损失或丧失交易机会。
5、法律风险：公司开展衍生品交易业务时，存在交易人员未能
充分理解交易合同条款和产品信息，导致经营活动不符合法律规定或
者外部法律事件而造成的交易损失。
五、风险管理措施
1、选择结构简单、流动性强、风险可控的金融衍生工具开展套
期保值业务，严格控制金融衍生品的交易规模。
2、严格控制金融衍生品的交易规模，公司只能在董事会授权额
度范围内进行以套期保值为目标的衍生品交易。

3、审慎选择交易对手和金融衍生产品，最大程度降低信用风险； 4、制定规范的业务操作流程和授权管理体系，配备专职人员，
明确岗位责任，严格在授权范围内从事衍生品交易业务；同时加强相