

证券代码：400059

证券简称：天珑 5

主办券商：兴业证券

天珑科技集团股份有限公司

关于 2024 年度开展衍生品套期保值业务的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，没有虚假记载、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法律责任。

一、衍生品套期保值业务概述

（一）业务品种

1、远期结售汇业务：对应未来某一天或某一期间的收付汇金额与时间，与银行签订远期结售汇合约，在交割日当天按约定的汇率进行收汇、付汇。

2、外汇、利率掉期业务：通过汇率或利率互换，在未来某一天或某一期间，将汇率或利率锁定。

3、外汇期权及期权组合产品：与银行签订外汇期权合约，就是否在规定的期间或在到期日内按照合约约定的执行汇率和其他约定条件（包括支付期权费用），买入或者卖出一定数量的外汇的选择权进行交易。

（二）是否构成重大资产重组

本次交易不构成重大资产重组。

（三）是否构成关联交易

本次交易不构成关联交易。

（四）审议和表决情况

本事项已经公司第十届董事会第二十次会议审议通过，该事项尚需提交公司 2023 年年度股东大会审议。

（五）本次对外投资不涉及进入新的领域

（六）投资标的是否开展或拟开展私募投资活动

本次投资标的不涉及开展或拟开展私募投资活动，不是已在中国证券投资基金业协会登记为私募基金管理人，不会将公司主营业务变更为私募基金管理业务。

（七）不涉及投资设立其他具有金融属性的企业

本次投资不涉及投资设立小额贷款公司、融资担保公司、融资租赁公司、商

业保理公司、典当公司、互联网金融公司等其他具有金融属性的企业。

二、衍生品套期保值业务的基本情况

（一）衍生品套期保值业务基本情况

金融资产的具体内容

公司（含合并报表范围内各级子公司）本次拟开展衍生品交易业务的最高持仓量不超过 30 亿美元（或等额货币），交易期限为 2023 年年度股东大会审议通过之日起至 2024 年年度股东大会召开之日止，在有效期内额度可滚动使用。公司将利用自有资金进行衍生品套期保值业务，套期保值业务合约的对手方为银行类金融机构。

（二）出资方式

本次开展衍生品套期保值业务的出资方式为

现金 资产 股权 其他

三、开展衍生品套期保值业务的主要内容

公司（含合并报表范围内各级子公司）本次拟开展衍生品交易业务的最高持仓量不超过30亿美元（或等额货币），上述额度在有效期内可滚动使用。

四、衍生品套期保值业务的目的、存在的风险和对公司的影响

（一）开展衍生品套期保值业务的目的

为实现以规避和防范外汇市场风险为目的的资产保值，降低外汇结算成本和汇率波动对公司的影响，公司拟开展衍生品套期保值业务。

（二）本次衍生品套期保值业务存在的风险

1、套期保值的业务风险

（1）市场风险：衍生品行情变化较大，可能产生因标的利率、汇率等市场价格波动引起的衍生品价格变动，造成亏损的市场风险；

（2）技术及内控风险：金融衍生品业务专业性较强，复杂程度较高，可能会由于操作人员未按规定操作程序进行交易操作或未能充分理解衍生品信息而造成一定风险；

（3）违约风险：在产品交付周期内，由于原材料价格周期大幅波动，客户主动违约而造成公司衍生品交易上的损失；

（4）政策及法律风险：因相关法律制度发生变化或交易对手违反相关法律制度或合同约定，造成合约无法正常执行而给公司带来损失。

2、套期保值业务的风险防控措施

(1) 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，在签订合同时严格按照公司预测的收汇期、付汇期和金额进行交易，所有远期结售汇业务均有正常的贸易背景。

(2) 公司制定了《外汇衍生品投资管理制度》、《衍生品套期保值业务内部控制制度》，对衍生品套期保值业务操作规定、业务审批权限、信息隔离措施、内部风险控制程序等方面做出了明确规定。为避免内部控制风险，公司财务部负责统一管理公司外汇套期保值业务，严格按照制度规定进行业务操作，有效的保证制度的执行。

(3) 公司高度重视应收账款的管理，为防止套期合约延期交割，公司尽可能采用信用证的方式与客户进行货款结算，以避免出现应收账款逾期的现象。

(4) 公司财务部外汇业务相关人员将持续跟踪外汇公开市场价格或公允价值变动，及时评估外汇套期保值交易的风险敞口变化情况，并定期向公司管理层报告。

(5) 公司内审部应每季度或不定期对套期保值业务的实际操作情况、资金使用情况和盈亏情况进行核查，保证套期保值业务交易和账务处理的准确和规范性。

(6) 公司套期保值业务均选择与经监管机构批准、具有外汇衍生品交易业务经营资格、并且交易信用级别高的大型商业银行合作。这类银行经营稳健、资信良好，基本可规避履约风险。

(三) 本次对外投资对公司经营及财务的影响

公司开展外汇套期保值业务是在确保公司日常运营所需流动资金和资金安全的前提下实施的，不影响公司日常资金正常周转需要，不影响公司主营业务的正常开展。

五、备查文件

第十届董事会第二十次会议决议。

特此公告。

天珑科技集团股份有限公司董事会

2024年4月30日