

**创新新材料科技股份有限公司**  
**2024 年第一次临时股东大会资料**



**2024 年 6 月**  
**山东 邹平**

# 创新新材料科技股份有限公司

## 2024 年第一次临时股东大会会议程

- 现场会议召开时间：2024 年 6 月 20 日（星期四）14 点 00 分
- 现场会议召开地点：山东省滨州市邹平市经济技术开发区月河六路中段创新第四工业园办公楼一层会议室
- 网络投票系统：上海证券交易所股东大会网络投票系统
- 通过交易系统投票平台的投票时间为股东大会召开当日的交易时间段，即 9:15-9:25,9:30-11:30, 13:00-15:00；通过互联网投票平台的投票时间为股东大会召开当日的 9:15-15:00。

一、由主持人宣布会议开始

二、审议会议议案

序号	议案名称	投票股东类型
		A 股股东
非累积投票议案		
1	《关于调整 2024 年度开展期货和衍生品套期保值业务相关事项的议案》	√

1、各议案已披露的时间和披露媒体

上述议案内容详见公司于 2024 年 6 月 5 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及上海证券交易所网站（<http://www.sse.com.cn>）上刊载的《第八届董事会第十三次会议决议公告》、《第八届监事会第十一次会议决议公告》、《关于调整 2024 年度开展期货和衍生品套期保值业务相关事项的公告》等相关公告。

2、特别决议议案：无

3、对中小投资者单独计票的议案：无

4、涉及关联股东回避表决的议案：无

应回避表决的关联股东名称：无

5、涉及优先股股东参与表决的议案：无

三、主持人宣布出席现场会议的股东和代理人人数及所持有表决权的股份总数情

况

#### 四、现场会议表决

1、推选计票人、监票人

2、对上述议案进行表决

#### 五、统计现场会议表决结果

六、宣读现场会议表决结果

七、对网络投票和现场投票结果进行合并统计

八、宣读会议整体表决结果

九、签署股东大会会议记录和决议

## 目录

- 一、《关于调整 2024 年度开展期货和衍生品套期保值业务相关事项的议案》 ...5

## 一、《关于调整 2024 年度开展期货和衍生品套期保值业务相关事项的议案》

各位股东：

公司于 2023 年 12 月 1 日召开第八届董事会第十一次会议、第八届监事会第九次会议，审议通过了《关于 2024 年度开展期货和衍生品套期保值业务的议案》，同意公司及合并报表范围内子公司 2024 年使用自有资金不超过 5.1 亿元（含持仓保证金与应付行情变化的风险金）额度开展期货和衍生品套期保值业务，其中：期货及场内期权保证金不超过 5 亿元，外汇衍生品保证金不超过 0.1 亿元。在上述额度范围内，资金循环使用。

为了规避部分产品受生产周期等影响导致采购端与销售端对应的铝基准价不同带来的铝价波动风险以及防止因汇率、利率等波动造成的对公司财务成本的影响，公司于 2024 年 6 月 4 日召开第八届董事会第十三次会议、第八届监事会第十一次会议，审议通过了《关于调整 2024 年度开展期货和衍生品套期保值业务相关事项的议案》，调整公司及合并报表范围内各子公司开展期货和衍生品套期保值业务的额度为不超过 7.3 亿元，其中：期货及场内期权保证金不超过 7 亿元，金融衍生品保证金、权利金不超过 0.3 亿元；拟将交易工具调整为期货、期权、金融衍生品等方式，交易品种调整为与生产经营相关的铝期货、场内期权等，与金融衍生品相关的远期结售汇、外汇套期保值、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率掉期、利率期权及其他组合产品等。

调整后公司套期保值业务开展情况如下：

### 一、交易情况概述

#### （一）交易目的

公司主营铝合金加工业务，采购与销售定价主要以当期上海有色网铝均价、长江有色铝价等市场价为基准。部分业务受生产周期等因素影响，采购端与销售端对应的铝基准价不同，一定程度上承担铝价波动的风险；同时，随着公司海外业务的开展，外汇汇率波动给公司经营成果可能带来一定影响；以及随着国内利率市场化改革，浮动利率贷款定价基准转换为 LPR 利率，未来利率的波动可能对公司部分融资业务产生影响。

为防范铝价波动和因汇率、利率波动造成的对财务成本的影响，公司调整开

展期货和衍生品套期保值业务的金额并增加金融衍生品交易业务品种，稳定盈利水平。交易工具包括期货、期权、金融衍生品等；交易品种包括与生产经营相关的铝期货、场内期权等，与金融衍生品相关的远期结售汇、外汇套期保值、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率掉期、利率期权及其他组合产品等。公司拟开展的期货和衍生品套期保值业务以生产经营为基础，以套期保值为目的，不进行以盈利为目的的投机和套利交易，不会影响公司主营业务发展。

## （二）调整后的 2024 年度开展期货和衍生品套期保值业务情况

### 1、调整后的交易金额

公司拟开展的 2024 年度期货和衍生品套期保值业务任意时点所需保证金、权利金及应对行情变化的风险金最高额度调整为不超过 7.3 亿元，其中：期货及场内期权保证金不超过 7 亿元，金融衍生品保证金、权利金不超过 0.3 亿元。在审批期限内可循环使用，即任一时点的交易金额不超过上述额度。

### 2、调整后的交易期限

授权期限：股东大会审议通过之日起至 2024 年 12 月 31 日。

### 3、资金来源

公司及全资或控股子公司的自有资金，不涉及募集资金。

### 4、调整后的交易方式

（1）交易工具：使用期货、期权、金融衍生品等方式进行套期保值。

（2）交易品种：交易品种包括与生产经营相关的铝期货、场内期权等业务，与金融衍生品相关的远期结售汇、外汇套期保值、外汇掉期、外汇期权、利率互换、利率掉期、利率期权及其他组合产品等。

（3）交易场所：公司开展铝期货和场内期权的交易场所在上海期货交易所；开展衍生品交易将只与经监管机构批准、具有衍生品业务经营资质、经营稳健且资信良好的金融机构开展，不会与前述金融机构之外的其他组织或个人进行交易。

## 二、审议程序

本次调整期货和衍生品套期保值业务相关事项已经公司第八届董事会第十三次会议、第八届监事会第十一次会议审议通过。本次开展期货和衍生品交易事项尚需提交公司股东大会审议，不构成关联交易。

## 三、套期保值的风险分析

（一）价格波动风险：期货及衍生品行情变动较大时，可能产生价格波动风

险，造成交易损失。

（二）流动性风险：期货及衍生品投资面临流动性风险，由于离交割月越近的合约交易量越少，面临近期月份仓位较重时实施平仓交易的满足性风险。此外，不合理的衍生品的购买安排可能引发公司资金的流动性风险。

（三）资金风险：期货及衍生品交易实行保证金制度和逐日盯市制度，可能会带来相应的资金风险，如投入金额过大，可能造成资金流动性风险，甚至因为来不及补充保证金而被强行平仓带来实际损失。

（四）内部控制风险：套期保值业务专业性较强，复杂程度较高，可能会产生由于内部控制体系不完善而造成风险。

（五）技术风险：由于无法控制和不可预测的系统故障、网络故障、通讯故障等造成交易系统非正常运行，导致交易指令延迟、中断或数据错误等问题。

#### **四、套期保值业务的风险控制措施**

（一）价格波动风险控制措施：将套期保值业务与公司生产经营相匹配，最大程度对冲价格波动风险。公司期货套期保值业务只限于在境内期货交易所交易的、且与公司生产经营所需的原材料铝相同的商品期货品种。公司开展衍生品交易将只与经监管机构批准、具有衍生品交易业务资质、经营稳健且资信良好的金融机构开展，不会与前述金融机构之外的其他组织或个人进行交易。

（二）流动性风险控制措施：公司开展套期保值工作已有多年，有着丰富的期货操作及管理经验，将按照合同及库存材料周期作为开仓合约依据，同时公司将严格按照套期保值方案，合规操作，及时申请套保头寸，做好仓位管理，控制好持仓风险和流动性风险。

（三）资金风险控制措施：严格控制套期保值的资金规模，合理计划和使用保证金。公司全年任一时点的套期保值投入保证金余额不超过人民币 7.3 亿元，公司将在股东大会及董事会授权范围内进行业务操作。公司将合理调度自有资金用于套期保值业务，不使用募集资金直接或间接进行套期保值。

（四）内部控制风险控制措施：公司将严格按照公司内部有关套期保值业务的管理制度要求，不断加强套期保值业务管理工作，健全和强化内部业务监管、审批及授权机制，组织业务关联岗位衔接人员参加相关培训，加强相关人员的职业道德教育及提升业务能力，增加风险管理及防范意识。同时建立异常情况及时报告制度，并形成高效的风险处理程序。

（五）技术风险控制措施：公司设立符合要求的计算机系统及相关设施，确

保交易工作正常开展；当发生故障时，及时采取相应处理措施以减少损失。

### 五、交易对公司的影响及相关会计处理

公司开展期货和衍生品套期保值业务，可以充分利用期货衍生品市场的套期保值功能，以期货和衍生品端损益对冲现货端铝价波动、汇率波动、利率波动对公司经营业绩的影响，稳定盈利水平，提升公司防御风险能力。同时，公司已就套期保值业务建立了相应的内控制度和风险防范措施，公司将审慎、合法、合规地开展套期保值业务，不会影响公司的正常生产经营。

公司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—套期会计》、《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》等相关规定执行，合理进行会计处理工作，对拟开展的套期保值业务进行相应的核算处理和列报披露。

本议案已经公司第八届董事会第十三次会议审议通过。

请各位股东予以审议！

创新新材料科技股份有限公司

2024 年 6 月 20 日