

证券代码：300236

证券简称：上海新阳

公告编号：2024-049

上海新阳半导体材料股份有限公司 关于开展金融衍生品交易的进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、开展金融衍生品交易业务情况概述

2023年4月25日，公司第五届董事会第十三次会议、第五届监事会第十二次会议审议通过了《关于使用闲置自有资金进行金融衍生品交易的议案》，公司为盘活证券资产，获取资产收益，在保证公司持续、合规经营的前提下谨慎参与金融衍生品市场交易。公司拟使用不超过人民币10亿元的自有资金（含证券资产）开展金融衍生品交易业务，在上述额度及期限内，资金可以循环滚动使用。公司独立董事对该投资事项发表了明确的独立意见，保荐机构天风证券出具了核查意见。详见公司于2023年4月27日披露于巨潮资讯网的公告。2023年5月18日，公司2022年度股东大会审议通过上述金融衍生品相关议案。

二、金融衍生品交易业务进展情况

2023年11月3日，公司通过场外质押授信的方式购买挂钩中证1000指数的场外期权金融衍生品1亿元，该产品买入后锁定期3个月。公司购入的场外期权金融衍生品的盈亏情形取决于挂钩标的中证1000指数的市场表现。根据证券公司提供的《场外期权估值报表》，2024年3月31日公司该产品单位净值-0.15915938，产生公允价值变动-15,915,938.00元；2024年6月30日公司该产品单位净值-0.25639925，产生公允价值变动-25,639,925.00元；截至2024年8月15日，该产品单位净值-0.28349684，产生公允价值变动-28,349,684.00元。

三、风险提示及风险控制措施

（一）投资风险

1. 市场风险：受国内外宏观经济形势、汇率和利率波动、证券市场波动、标的行业周期、标的公司经营管理状况等多种因素的影响，产品持有期间挂钩标的的中证 1000 指数波动较大时，产品估值将会随之波动，可能产生较大浮亏或浮盈，公司的资产安全及收益存在一定的不确定性。

2. 流动性风险：已购买产品的赎回、出售受指数波动因素的影响，但公司需遵守相应的交易结算规则和协议，可能存在一定的流动性风险。

3. 操作风险：金融衍生品交易业务专业性较强，复杂程度较高，公司在开展业务时，如操作人员未按规定程序进行交易操作或未能充分理解投资产品的信息，将存在一定的操作风险。

4. 法律风险：因相关法律发生变化或交易对手违反相关法律制度可能造成合约无法正常执行，从而给公司带来损失。

(二) 风控措施

1. 公司已建立了《证券投资和衍生品交易管理制度》及相关作业要求，对从事证券投资和衍生品交易的操作原则、交易审批权限、操作程序、风险管理及信息披露做出了明确规定，规范金融衍生品交易行为，强化风险控制。

2. 公司严格控制开展金融衍生品交易业务的资金规模，未超过已审议的额度范围，未使用投资杠杆，以确保资金整体安全。公司将最大限度控制投资风险，审慎开展金融衍生品交易业务。

3. 公司持续关注产品挂钩标的的中证 1000 指数的波动情况，及时调整投资策略及规模。若发现或判断有不利因素，将及时采取相应的措施，严格控制风险。受中证 1000 指数波动影响，目前所列示金额为公允价值变动情况，未赎回之前，所投资产品盈亏情况尚不确定。

4. 公司独立董事、监事会有权对公司购买的衍生金融产品进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。公司内部审计部门定期对金融衍生品交易业务执行情况监督、核查，及时对存在的问题提出整改意见，严格控制风险。

四、对公司的影响

公司开展金融衍生品交易业务所使用的资金为证券资产，不会对公司日常运营资金需求和业务的正常开展造成影响。截至 2024 年 6 月 30 日，公司持有

货币资金共计 8.00 亿元，资产负债率为 25.77%，公司货币资金较为充沛，风险抵抗能力强，资产负债率低，整体财务状况良好。

上述事项对公司财务数据的影响未经审计，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

上海新阳半导体材料股份有限公司董事会

2024 年 8 月 17 日