

天津泰达股份有限公司

关于开展外汇衍生品交易业务的公告

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。

重要内容提示：

1. 天津泰达股份有限公司（以下简称“公司”）拟开展的外汇衍生品交易业务不以投机为目的，旨在规避汇率风险。公司拟以自有资金利用金融机构提供的外汇产品开展以保值为目的的外汇远期、外汇掉期、外汇期权等衍生品业务，同一时点敞口余额累计不超过 1.3 亿美元（或等值其他外币及人民币），且与外币业务规模、期限相匹配，期限一年。

2. 该事项已经公司第十一届董事会第十一次（临时）会议审议通过，尚需提交股东大会审议。

3. 风险提示：开展外汇衍生品交易存在市场风险、流动性风险、履约风险和其它风险等风险，敬请广大投资者注意风险。

为降低外汇汇率风险，公司拟以自有资金利用金融机构提供的外汇产品开展以保值为目的的外汇远期、外汇掉期、外汇期权等衍生品交易业务，具体公告如下：

一、投资情况概述

（一）开展外汇衍生品交易的目的

公司开展金融衍生品交易业务，是在合法合规前提下，以正常业务背景为依托，以规避和防范汇率波动的抗风险能力为主要目的，防范汇率波动对公司利润和股东权益造成不利影响，增强公司财务稳健性，进一步提高公司应对外汇波动风险的能力，更好地规避和防范外汇汇率波动风险。

（二）开展外汇衍生品交易的金额、方式和资金来源

公司拟以自有资金利用金融机构提供的外汇产品开展以保值为目的的外汇

远期、外汇掉期、外汇期权等衍生品业务，同一时点敞口余额累计不超过 1.3 亿美元（或等值其他外币及人民币），且与外币业务规模、期限相匹配。

（三）开展外汇衍生品交易的期限

本次外汇衍生品业务与公司外币业务期限相匹配，期限一年。

二、审议程序

公司于 2024 年 12 月 13 日召开第十一届董事会第十一次（临时）会议，审议通过了《关于开展外汇衍生品业务的议案》，本事项需提交股东大会审议。

三、交易风险分析及风控措施

（一）风险分析

虽然公司开展外汇衍生品交易遵循锁定汇率风险原则，不做投机性、套利性的交易操作，但外汇衍生品交易仍存在一定的风险：

1.市场风险：当国际、国内的政治经济形势发生变化时，对应汇率会发生相应的变化，外汇衍生品交易合约汇率与到期日实际汇率的差异将产生交易损益的风险。

2.流动性风险：因开展的外汇衍生品交易业务均通过金融机构操作，存在市场流动性不足而无法完成交易的风险。

3.履约风险：在合约期限内合作的金融机构存在出现重大不可控风险的可能，开展金融衍生品业务存在合约到期无法履约造成违约而带来的风险。公司开展外汇衍生品交易对手均为信用良好且与公司已建立长期业务往来的金融机构，履约风险低。

4.其它风险：因相关法律法规发生变化或交易对手违反合同约定条款可能造成合约无法正常执行而给公司带来损失的风险。

（二）风控措施

1.公司开展的外汇衍生品交易以锁定成本、规避和防范汇率风险为目的，禁止任何风险投机行为。

2.公司将审慎审查与银行签订的合约条款，严控风险管理，以防范法律风险。

3.公司仅开展与存量外币业务规模、期限相匹配的外汇衍生品业务。

4.公司将持续跟踪外汇衍生品公开市场价格或公允价值变动，及时评估外汇衍生品交易的风险敞口变化情况，发现异常情况及时上报。

四、交易相关会计处理

公司根据《企业会计准则》相关规定及其指南，对拟开展的衍生品交易业务进行相应的核算与会计处理，反映资产负债表及损益表相关项目。

五、外汇衍生品交易对公司的影响

为规避汇率波动带来的风险，公司开展金融衍生品业务，该业务匹配公司的存量外币业务，充分利用外汇衍生交易的套期保值功能，对冲国际业务中的汇率风险，降低汇率波动对公司的影响，符合公司长远发展及公司股东的利益。

六、备查文件

- （一）《天津泰达股份有限公司第十一届董事会第十一次（临时）会议决议》
- （二）《关于开展衍生品交易的可行性分析报告》
- （三）《天津泰达股份有限公司融资管理制度》

特此公告。

天津泰达股份有限公司

董 事 会

2024年12月14日