

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 2025 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。

天珑科技集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2025 年 4 月 30 日召开第十一届董事会第五次会议，会议审议通过《关于 2025 年度开展衍生品套期保值业务的议案》，该议案尚需提交公司 2024 年年度股东大会审议，具体情况如下：

一、开展衍生品套期保值业务的目的及必要性

随着公司全球化战略布局的持续推进，公司面临的外汇风险敞口相应地持续扩大。为有效应对复杂多变的国际政治经济环境及汇率波动风险，降低外汇结算成本，公司拟审慎开展衍生品套期保值业务。该业务将严格恪守风险中性原则，禁止任何形式的投机交易，确保与公司实际经营需求紧密契合，有利于进一步增强公司抗风险能力及增强财务稳健性，为公司持续稳健发展提供有力保障。

二、开展衍生品套期保值业务的基本情况

1、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。

2、交易额度及期限

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 20 亿美元（或等额货币），交易期限自公司 2024 年年度股东大会审

议通过之日起至 2025 年年度股东大会召开之日止，在前述额度及有效期内，资金可以循环滚动使用。

3、资金来源及合约对手

本次资金来源为公司自有资金，业务合约的对手方为银行类金融机构。

三、开展衍生品套期保值业务的风险分析及采取的风险防控措施

1、主要风险分析

公司在开展衍生品套期保值业务可能面临如下风险：

（1）市场风险：衍生品市场价格波动较大，可能因汇率、利率等标的资产价格剧烈变动导致亏损。在全球政治经济环境复杂多变的背景下，市场风险可能被进一步放大，影响套期保值效果。

（2）技术及内控风险：金融衍生品业务专业性强、复杂度高，可能因操作人员未严格执行交易程序或对衍生品条款理解不足而导致操作失误。同时，公司内部控制系统若未能及时完善，可能导致风险敞口管理不善、交易记录不完整等问题，进而影响业务执行的准确性和有效性。

（3）违约风险：在产品交付周期内，原材料价格大幅波动可能引发客户违约风险。全球供应链不稳定及交易对手信用风险可能进一步加剧违约概率，给公司带来额外损失。

（4）政策及法律风险：国内外相关法律法规的变化可能导致合约无法正常运行或因交易对手违反合同约定给公司带来损失。不同国家和地区的监管政策差异可能增加业务操作的复杂性和不确定性，税收政策、外汇管制等变化也可能对业务成本和收益产生直接影响。

2、风险防控措施

为有效管理和控制衍生品套期保值业务的风险，公司将从以下六个方面采取措施，切实降低潜在风险对公司经营的影响：

（1）严格遵守风险中性原则：公司开展衍生品套期保值业务将严格遵循风险中性原则，禁止任何形式的投机性交易。所有交易均以实际业务需求为基础，确保交易规模、期限与公司预测的收付汇周期及金额相匹配，并具备真实的贸易背景。

（2）完善制度与内控体系：公司已制定并实施《外汇衍生品投资管理制度》

及《衍生品套期保值业务内部控制制度》，明确业务操作规范、审批权限、信息隔离措施及风险控制程序。公司财务部作为业务主管部门，将严格按照制度规定执行操作，确保制度的有效落实，防范操作风险。

（3）强化应收账款管理：为降低套期合约延期交割风险，公司将优先采用信用证等安全结算方式与客户进行货款结算，确保应收账款及时回笼，避免逾期现象发生，保障资金链的稳定性。

（4）动态监控与风险评估：公司财务部相关操作人员将持续跟踪外汇市场价格及公允价值变动，定期评估套期保值交易的风险敞口变化情况并向管理层提交专项报告，确保风险可控。

（5）内部审计与监督：公司内审部将定期或不定期对套期保值业务的操作情况、资金使用及盈亏状况进行核查，确保业务操作的合规性、账务处理的准确性及资金使用的合理性。

（6）审慎选择交易对手：公司套期保值业务将仅与经国家监管机构依法批准设立、具有相关业务资质且信用评级高的大型商业银行合作。此类机构经营稳健、资信良好，可有效降低履约风险，保障交易安全。

通过上述措施，公司将全面提升衍生品套期保值业务的风险管理能力，确保业务开展的规范性、安全性和有效性。

四、开展衍生品套期保值业务对公司的影响

开展衍生品套期保值业务均以正常生产经营为基础，以具体经营业务为依托，以锁定成本、规避和防范汇率风险为目的，通过审慎、灵活使用金融工具对冲风险，不会对公司正常资金周转和主营业务运作造成不利影响。

五、备查文件

（一）公司第十一届董事会第五次会议决议。

特此公告。

天珑科技集团股份有限公司董事会

2025年4月30日