

证券代码：600075

股票简称：新疆天业

公告编号：临 2025-048

债券代码：110087

债券简称：天业转债

新疆天业股份有限公司 关于公司继续开展套期保值业务的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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法律责任。

重要内容提示：

● 交易目的：为规避和转移现货市场价格波动风险，保持公司经营业绩持续、稳定，公司及控股子公司拟利用期货市场套期保值的避险机制，继续对公司生产经营相关的主要生产产品、原材料等开展套期保值业务，以减少因价格波动对生产经营带来的影响，提升公司抗风险能力，实现公司及子公司业务稳定持续发展。

● 交易金额：公司开展套期保值业务，任一交易日持有的全部交易合约所占用的保证金最高额度不超过 3,000 万元（含），在上述额度及决议有效期内，可循环滚动使用，使用期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过已审议额度。

● 交易场所及品种：公司开展套期保值业务品种为公司主要生产产品、所需原材料以及产业链生产经营过程中涉及到且出现风险敞口需要进行套期保值的商品，交易工具包括但不限于期权、期货、远期等衍生品合约。交易场所为大连期货交易所、郑州期货交易所等境内合规公开交易场所。根据业务实施情况，实施主体为公司及控股子公司。

● 已履行及拟履行的审议程序：本事项已经公司九届十二次董事会审议通过。投入资金规模在董事会审议范围之内，无需提交公司股东大会审议。

● 特别风险提示：公司及控股子公司开展套期保值业务不以投机为目的，主要为减少因价格波动对生产经营带来的影响；交易时严格遵循合法合规、审慎和安全的原则，但仍可能存在市场风险、流动性风险、操作风险等其他风险，敬请广大投资者注意投资风险。

一、交易情况概述

（一）交易目的

为规避和转移现货市场价格波动风险，保持公司经营业绩持续、稳定，公司及控股子公司拟利用期货市场套期保值的避险机制，继续对公司生产经营相关的主要生产产品、原材料等开展套期保值业务，以减少因价格波动对生产经营带来的影响，提升公司抗风险能力，实现公司及子公司业务稳定持续发展。

公司及控股子公司开展套期保值业务基于全年计划产量、现货业务贸易量、交易期限确定，以具体业务合同为依托，交易金额、交易期限与实际业务开展相匹配，利用期货的套期保值功能进行价格风险控制，不进行以投机为目的的期货交易，可以有效应对风险，稳定公司的经营业绩，保障公司的持续健康发展。

本次套期保值业务不会影响公司主营业务的发展，所需资金使用安排合理。

（二）交易金额

公司开展套期保值业务，任一交易日持有的全部交易合约所占用的保证金最高额度不超过 3,000 万元（含），在上述额度及决议有效期内，可循环滚动使用，使用期限内任一时点的交易金额（含前述交易的收益进行再交易的相关金额）不超过已审议额度。

（三）资金来源

资金来源为公司自有资金，不涉及募集资金。

（四）交易方式

公司开展套期保值业务品种为公司主要生产产品、所需原材料以及产业链生产经营过程中涉及到且出现风险敞口需要进行套期保值的商品，交易工具包括但不限于期权、期货、远期等衍生品合约。交易场所为大连期货交易所、郑州期货交易所等境内合规公开交易场所。根据业务实施情况，实施主体为公司及控股子公司。

（五）交易期限

套期保值额度有效期：自董事会审议通过之日起一年内有效。

在上述额度有效期内，授权公司董事长及其授权人员审核并签署套期保值业务方案及相关合同，无需再上报董事会。

二、审议程序

公司于 2025 年 6 月 27 日召开九届十二次董事会，审议通过了《关于公司继续开展套期保值业务的议案》。公司本事项不构成关联交易，投入资金规模在董事会审议范围之内，无需提交公司股东大会审议。

三、交易风险分析及风控措施

（一）风险分析

公司仅开展与生产经营相关的主要生产产品、原材料等套期保值业务，不进行投机交易，严格控制资金规模，但进行套期保值交易仍存在一定的风险，具体如下：

1. 市场风险：将受国际及国内经济政策和经济形势、汇率和利率波动等多种因素影响，如原料和产品价格、汇率和利率行情等变动较大时，可能会造成交易损失。
2. 流动性风险：如果合约活跃度较低，导致套期保值交易无法成交或无法在合适价位成交，可能会造成实际交易结果与方案设计出现较大偏差，从而产生交易损失。
3. 操作风险：套期保值业务的专业性较强，复杂程度较高，存在操作不当或操作失败，从而带来风险。
4. 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。
5. 资金风险：当公司没有及时补足保证金时，可能会被强制平仓而遭受损失。
6. 政策法律风险：如套期保值市场的法律法规、行业政策等发生重大变化，可能引起市场波动、交易规则等发生重大变化或者合约无法交易的风险。

（二）风控措施

1. 将商品期货套期保值业务与公司生产经营相匹配，严格控制期货头寸，持续对套期保值的规模、期限进行优化组合，确保公司的利益。
2. 公司已建立《新疆天业股份有限公司套期保值业务管理制度》，明确了开展套期保值业务的组织机构、工作机制、业务流程及风险控制措施，形成了较为完整的风险管理体系。
3. 公司的商品期货套期保值业务只限于在合法合规的期货交易所上市的相关的品种合约，不进行以逐利为目的的任何投机交易。公司套期保值业务选择的交易场所和交易品种市场透明度大，成交活跃，流动性较强，成交价格 and 结算价格能充分反映衍生品的公允价值。

4. 在业务操作过程中，严格遵守有关法律法规的规定，防范法律风险，定期对套期保值业务的规范性、内控机制的有效性等方面进行监督检查。

5. 公司严格控制商品期货套期保值的资金规模，严格按照公司套期保值业务管理制度规定下达操作指令，根据审批权限进行对应的操作，公司留存一定比例的风险备用金用于保证套期保值过程中出现亏损时及时补充保证金，避免因期货账户中资金无法满足和维持套保头寸时出现现金流动性风险。

6. 公司不断加强相关业务人员的职业道德教育及业务培训，提高综合素质。加强对国家法律法规及相关政策的把握和理解，及时合理地调整套期保值思路与方案。

四、交易对公司的影响及相关会计处理

公司及控股子公司出于公司稳健经营的需求，以套期保值为目的，在充分保障正常经营活动并有效控制风险的前提下开展套期保值业务，有利于利用期货市场套期保值功能对冲因市场价格剧烈变动导致的原材料采购成本上升、产品销售价格下滑等对公司经营业绩的影响；有利于利用期货市场套期保值的避险机制，降低公司经营风险，适应激烈的市场竞争，提升可持续发展能力。公司使用自有资金开展期货套期保值业务，计划投入的保证金规模与自有资金、经营情况和实际需求相匹配，不会影响公司正常经营业务。公司已制定了相关风险控制措施，有效规范交易行为，严格控制风险，不存在损害公司及全体股东利益的情形。

公司将按照财政部《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》及《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》等相关规定及其指南，对开展的套期保值业务进行相应的会计核算、列报及披露。

特此公告。

新疆天业股份有限公司董事会

2025 年 6 月 28 日